

뉴욕증시 - 지표부진 속 유가&애플 급등에 상승마감

- 1.국제유가, 공급과잉 해소 기대감과 골드만삭스 유가 전망치 상향에 급등
(WTI +3.3%...11월3일 이후 최고치)
- 2.워런 버핏, 애플 주식 11억달러 어치 매수
...애플 주가 3.71% 상승
- 3.美 지표 부진
-5월 NY엠패이어스테이트제조업지수 9.56 → -9.02 (예상:6.50)
-5월 NAHB주택시장지수 58 → 58 (예상:59)
- 4.리치먼드 연은 총재 '6월 금리인상을 위한 강한 근거들 있다 '
- 5.유럽 주요국 증시, 증 지표부진 & 유가 상승에 혼조 마감

| 국제 증시 | | | 국제 상품 | | |
|--------|--------------------|------------|------------|---------|----------|
| DOW30 | 17710.71 | (+1.00%) | WTI | 47.72 | (+3.3%) |
| NASDAQ | 4774.46 | (+1.22%) | COMEX금 | 1274.20 | (+0.1%) |
| S&P500 | 2066.66 | (+0.98%) | COMEX구리 | 2.0890 | (+0.72%) |
| KOSPI | 1967.71 | (+0.05%) | 주요국가 10y국채 | | |
| KOSDAQ | 701.46 | (-0.41%) | 한국 | 1.774% | (+0.6bp) |
| 국제 통화 | | | 미국 | 1.75% | (+5.3bp) |
| 유로/달러 | 1.1319 | (+0.0010) | 영국 | 1.39% | (+1.8bp) |
| 유로/엔 | 123.42 | (+0.55) | 독일 | 0.14% | (+1.9bp) |
| 달러/엔 | 109.01 | (+0.42) | 프랑스 | 0.49% | (+1.6bp) |
| 달러/위안 | 6.5343 | (+0.0097) | 이탈리아 | 1.47% | (+0.4bp) |
| 원/달러 | 1179.70 | 전일 1171.40 | 스페인 | 1.60% | (+0.2bp) |
| NDF | 1180.00 / 1181.00원 | 0.25원 하락 | 그리스 | 7.20% | (-5.1bp) |

| 주간 예정 지표 | | | |
|----------|-----------------|----------|----------|
| | 경제지표 | Previous | Forecast |
| | -4월 산업생산 (MoM) | -0.6% | 0.3% |
| | -4월 건축허가 (MoM) | -7.7% | 4.3% |
| 미국 | -4월 주택착공 (MoM) | -8.8% | 2.9% |
| | -4월 CPI (MoM) | 0.1% | 0.3% |
| | -4월 근원CPI (MoM) | 0.1% | 0.2% |
| 유로존 | -3월 무역수지 | 19.0B | 22.5B |
| 영국 | -4월 CPI (MoM) | 0.4% | 0.3% |

1.전일 장중 동향

*KTB : 시가 110.38 / 종가 110.37

*LKT : 시가 129.76 / 종가 129.65

1)국고 3년 지표물인 15-7호는 전 거래일 대비 0.1bp 오른 1.443%에 출발. 국고 10년 지표물 15-8호는 0.4bp 하락한 1.764%에 시작. 레벨부담과 인하 기대감이 팽팽히 대립하며 좁은 보험권에서 등락함.

-외인이 장 초반부터 3년 국채선물 매수세를 확대했지만, 시장은 좀처럼 보험권 등락을 벗어나지 못하는 모습을 보임. 국고채 10년물 입찰이 호조를 보였다는 소식과 OECD가 한국의 올해 경제성장률 전망치를 2%대로 낮췄다는 소식도 시장에 변동성을 주지 못함.

2)CRS와 IRS 금리가 소폭 상승. 주말에 특별한 이벤트가 발생하지 않아 거래가 상당히 정체됐음. 장중 OECD의 발표가 있었지만, 이미 금리인하를 반영해서인지 가격 부담에 수급 변화는 크지 않았음.

-정부 쪽에서 추경 얘기가 흘러나왔는데 좀 더 구체화한다고 하면 시장은 다시 금리인하 베팅을 시작할 수 있어 보임. 펀더멘털 보다는 외인 동향이나 경기부양에 대한 정책조합에 좀 더 신경을 쓸 것으로 예상됨.

-연기금의 물량으로 CRS 금리가 떨어졌던 부분이 있는데 이를 일부 되돌리는 측면도 있고 환율이나 IRS 동향을 보고 베이스를 맞추는 등 큰 움직임이 나타나고 있진 않음.

-CD 금리가 빠졌지만, 당장 시장이 이를 반영하는 모습은 제한됨. 당분간 큰 모멘텀 없이 박스권을 유지할 수 있다고 예상됨.

| 국내 주요 금리 | | | BOND SWAP SPREAD | | |
|------------|--------|----------|------------------|---------|----------|
| 3y | 1.443% | (+0.1bp) | 3y | -3.6bp | (+0.2bp) |
| 5y | 1.539% | (+0.6bp) | 5y | -8.7bp | (-0.4bp) |
| 10y | 1.774% | (+0.6bp) | 10y | -18.4bp | (-0.6bp) |
| CD | 1.580% | (-2.0bp) | | | |

| IRS OUTRIGHT | | | IRS SPREAD | | |
|--------------|---------|-----------|--------------|-------|-----------|
| 1Y | 1.4425% | (+0.25bp) | 1*2Y | -4.5 | (0) |
| 2Y | 1.3975% | (+0.25bp) | 2*3Y | 1.00 | (0) |
| 3Y | 1.4075% | (+0.25bp) | 2*5Y | 5.50 | (0) |
| 5Y | 1.4525% | (+0.25bp) | 3*5Y | 4.50 | (0) |
| 7Y | 1.5025% | (0) | 5*7Y | 5.00 | (-0.25bp) |
| 10Y | 1.5900% | (0) | 5*10Y | 13.75 | (-0.25bp) |