

0.

뉴욕증시 - 뉴욕증시 브렉시트 충격에 급락 ...다우 3.39% 하락 마감

1. 영국 국민투표 개표 결과, 찬성 51.9% > 반대 48.1% ...브렉시트 최종 확정

...투표율, 71.8%...1992년 총선 이후 최고

- * 금융 업종, 5% 넘게 급락 ...2011년 이후 약 5년 만에 최악
- * 英 파운드, 7% 넘게 폭락 ...30년 최저치 기록후 소폭 반등
- * 공포지수 VIX, 49.33% 폭등 (25.76)
- * 유로존 'PIGS' 국채금리 일제히 급등
- * 브렉시트 '빙산의 일각'...추가 EU 탈퇴도 우려
- * 글로벌 은행들, 영국 이탈 시작됐다 <FT>

2. 연준, 유동성 공급 준비...ECB·인민은행도 한 목소리

- * 연준, 기존 스와프라인 통해 달러 유동성 공급 준비돼
- * 英 중앙은행 총재 "유동성 지원위해 400조원 준비" ...세계 중앙은행 총재들 "영란은행의 비상조치 지지"
- * 일본 재무성·BOJ, 엔화 외환시장 개입 가능 시사

3. 무디스, 영국 등급전망 '부정적'으로 강등 ...등급 'Aa1' 유지

- * 피치, 브렉시트 투표 결과 영국 등급에 '부정적'

4. 브렉시트 영국 재투표 청원 4백만명 돌파

- * 재투표 법적근거 2가지 ① 투표율 75% 미만 ② 탈퇴비율 60%미만

5. G7, 브렉시트 투표결과 후 시장 지지 및 협력

6. 국제유가, 브렉시트 우려에 4.93% 급락

7. 美 경기지표 부진

- * 5월 내구재주문 (MoM) 3.4% → -2.2% (예상:-0.5%) ...3개월만에 최대 낙폭
- * 5월 근원내구재주문 (MoM) 0.5% → -0.3% (예상:0.2%)
- * 6월 미시간대소비자신뢰지수 94.3 → 93.5 (예상:94.0)

8. 유럽증시, 브렉시트 현실화에 범유럽지수 스톡스600 7.03% 폭락

...2008년 10월 리먼 브라더스 사태 이후 최대 하락

- * 유럽 주식 팔려는 투자자들 급증...일부 거래소 15분간 거래 중단
- * 개장 직후 유럽 증시 거래량, 평소보다 700% 급증
- * 英·獨 증권거래소, 브렉시트에도 합병 예정대로 진행

국제 증시			국제 상품		
DOW30	17399.86	(-3.39%)	WTI	47.64	(-4.93%)
NASDAQ	4707.98	(-4.12%)	COMEX금	1322.40	(+4.7%)
S&P500	2037.30	(-3.60%)	COMEX구리	2.1105	(+2.90%)
KOSPI	1925.24	(-3.09%)	주요국가 10y국채		
KOSDAQ	647.16	(-4.76%)	한국	1.500%	(-12.7bp)
국제 통화			미국	1.56%	(-18.6bp)
유로/달러	1.1111	(-0.0273)	영국	1.08%	(-28.9bp)
유로/엔	113.61	(-7.26)	독일	-0.05%	(-14.3bp)
달러/엔	102.19	(-3.95)	프랑스	0.38%	(-7.3bp)
달러/위안	6.5776	(+0.0118)	이탈리아	1.55%	(+15.3bp)
원/달러	1179.90	전일 1150.20	스페인	1.62%	(+15.9bp)
NDF	1173.00 / 1174.00원	6.90원 하락	그리스	8.31%	(+76.6bp)

주간 예정 지표			
국가/날짜	경제지표	Previous	Forecast
6월 27일 [ECB 포럼 (~29일)]			
미국	-6월 서비스PMI	51.3	
	-6월 달러스연은제조업활동지수	-20.8	-16.0
6월 28일 [EU 정상회담 (~29일)]			
[BOE 금융정책위원회의]			
[금통위 의사록]			
미국	-1분기 GDP (QoQ)	0.8%	1.0%
	-6월 CB소비자신뢰지수	92.6	93.3
6월 29일			
미국	-5월 잠정주택판매 (MoM)	5.1%	-1.1%
	-5월 개인지출 (MoM)	1.0%	0.4%
	-5월 근원PCE물가지수 (MoM)	0.2%	0.2%
유로존	-6월 소비자신뢰지수	-7.0	-7.0
독일	-6월 CPI (MoM)	0.3%	0.2%
일본	-5월 소매판매 (YoY)	-0.8%	-1.6%
6월 30일			
미국	-신규실업수당청구건수	259K	
	-6월 시카고PMI	49.3	50.5
유로존	-6월 CPI (YoY)	-0.1%	
영국	-1분기 GDP (QoQ)	0.4%	0.4%
독일	-6월 실업률	6.1%	6.1%
일본	-5월 산업생산 (MoM)	0.5%	-0.1%
7월 1일			
미국	-6월 ISM제조업PMI	51.3	51.5
	-6월 제조업PMI	51.4	
중국	-6월 제조업PMI	50.1	50.0
	-6월 Caixin제조업PMI	49.2	49.2
	-6월 비제조업PMI	53.1	
유로존	-6월 제조업PMI	52.6	52.6
	-5월 실업률	10.2%	10.1%
독일	-6월 제조업PMI	54.4	54.4

1. 전일 장중 동향

*KTB: 시가 110.71 / 종가 110.98

*LKT: 시가 131.15 / 종가 132.40

1) 영국의 브렉시트 결정 여파가 이번주에도 지속될 것으로 전망. 다만 브렉시트 불확실성은 해소 되었다는 점에서 시장 참가자들은 한국 추가 금리 인하 여부에 주목. 정부는 "필요시 비상대책을 동원"하겠다는 입장을 밝힘. 또한 미국에서도 BOA가 올해 경제성장률을 하향 조정하였고, 연준 및 ECB는 유동성 공급을 준비하겠다는 입장. 한국 채권시장에서는 국채 3년물이 기준금리를 돌파함에 따라 레벨 부담이 되는 상황에서도 강세가 지속될 것으로 전망.

2) IRS 금리는 브렉시트 쇼크에 큰 폭으로 하락, 커브도 큰 폭으로 플랫. 1년물이 5.5bp, 10년물이 11.5bp 하락하는 등 모든 테너에서 급락. 비드가 거의 없는 상황에서 브렉시트 가능성을 적게 보았던 시장 참가자들의 손절성 오퍼가 강세를 보였고, 이번주에도 시장 전체의 강세가 지속될 전망.

3) CRS 시장은 채권 시장과 비교에 더욱 큰 폭으로 하락. 전체적으로 비드가 전무한 상황에서 금리는 전 구간에 걸쳐 15bp 안팎으로 하락. 최근에 부채 스왑 물량에 따른 비드도 모습을 볼 수 없었고, 전체적으로 공포스러운 분위기가 확산.

국내 주요 금리			BOND SWAP SPREAD		
3y	1.249%	(-8.8bp)	3y	-4.4bp	(+0.8bp)
5y	1.304%	(-10.4bp)	5y	-7.7bp	(+1.2bp)
10y	1.500%	(-12.7bp)	10y	-18.3bp	(+1.2bp)
CD	1.370%	(-2.0bp)			

IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.2600%	(-5.25bp)	1*2Y	-5.50	(-2.5bp)
2Y	1.2050%	(-7.75bp)	2*3Y	0.00	(-0.25bp)
3Y	1.2050%	(-8.0bp)	2*5Y	2.25	(-1.5bp)
5Y	1.2275%	(-9.25bp)	3*5Y	2.25	(-1.25bp)
7Y	1.2650%	(-9.75bp)	5*7Y	3.75	(-0.5bp)
10Y	1.3175%	(-11.50bp)	5*10Y	9.00	(-2.25bp)