

뉴욕증시 - '브렉시트' 충격 완화, 3대 지수 이틀째 1.5% 이상 반등

1. EU 정상들 "英, 자유 이동 보장 없으면 단일시장 특혜도 없다"
2. 국제유가, 美 원유재고 ↓·브렉시트 우려 완화에 4.24% 급등
3. 美 경기지표 혼조
 - * 5월 잠정주택판매 (MoM) 3.9% → -3.7% (예상:-1.1%)
 - * 5월 개인지출 (MoM) 1.1% → 0.4% (예상:0.4%)
 - * 5월 근원PCE물가지수 (MoM) 0.2% → 0.2% (예상:0.2%)
4. 유럽증시, '브렉시트' 충격 완화, 3% 넘게 반등
5. 올란드 프랑스 대통령 "런던, 유로화 청산업무 못할 것"
6. 피치 "영국에서 투자 2018년까지 20% 감소"
7. 독일증권거래소, 브렉시트에도 런던거래소 합병 절차 지속

국제 증시			국제 상품		
DOW30	17694.68	(+1.64%)	WTI	49.88	(+4.24%)
NASDAQ	4779.25	(+1.86%)	COMEX금	1326.90	(+0.7%)
S&P500	2070.77	(+1.70%)	COMEX구리	2.1835	(+0.60%)
KOSPI	1956.36	(+1.04%)	주요 국가 10y국채		
KOSDAQ	669.88	(+1.60%)	한국	1.459%	(-2.7bp)
국제 통화			미국	1.52%	(+4.91bp)
유로/달러	1.1123	(+0.0060)	영국	0.95%	(-1.28bp)
유로/엔	114.41	(+0.73)	독일	-0.13%	(-1.42bp)
달러/엔	102.81	(+0.07)	프랑스	0.21%	(-2.53bp)
달러/위안	6.6324	(-0.0204)	이탈리아	1.37%	(-2.75bp)
원/달러	1160.20	전일 1171.30	스페인	1.25%	(-5.75bp)
NDF	1154.00 / 1155.00원	6.15원 하락	그리스	7.97%	(-41.16bp)

금일 예정 지표			
국가	경제지표	Previous	Forecast
[ECB 통화정책회의록]			
미국	-신규실업수당청구건수	259K	267K
	-6월 시카고PMI	49.3	50.7
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%

1. 주요 뉴스

<브렉시트> ECB 총재 "중앙銀 정책공조 중요...환율전쟁은 공멸의 길" - 연합뉴스 2016.06.29

<http://news.naver.com/main/read.nhn?mode=LSD&mid=shm&sid1=101&oid=001&aid=0008506045>

- 브렉시트로 유로존 성장률 최대 0.5%p 하락 전망
- 마리오 드라기 유럽중앙은행(ECB) 총재는 "중앙은행들의 정책공조가 그 어느 때보다 중요하다"면서 "이른바 환율전쟁으로 불리는 국가 간 경쟁적 통화절하는 세계 경제가 공멸로 나아가는 길"이라고 경고
- ECB는 유로존 성장률을 2016년 1.6%, 2017년 1.7%, 2018년 1.8%로 전망하였으나, 드라기 총재의 발언을 고려하면 유로존의 성장률은 1%대 초반으로 떨어질 것으로 전망

<브렉시트> 버냉키 전 연준의장 "금융위기 가능성 낮다"(종합) - 연합뉴스 2016.06.29

<http://news.naver.com/main/read.nhn?mode=LSD&mid=shm&sid1=101&oid=001&aid=0008505978>

- 최대 피해자는 영국..."향후 수년간 엄청난 불확실성 후유증 시달릴 것"
- 버냉키 전 의장 "각국 중앙은행들이 금융기관의 재무 상황을 예의 주시하고 있고, 지금까지 심각한 문제점이 나타나지는 않았다"며 브렉시트 때문에 "현 시점에서 금융위기가 발생할 가능성은 꽤 낮다", "최근 몇 년간 은행들이 자본을 확충한 점도 (브렉시트 충격 완화에) 도움이 될 것"이라고 발언
- "정치적인 요인이 현 시점에서 금융 안정성을 가장 크게 위협하는 요인"라고 언급

파월 美연준 이사 "브렉시트로 추가 금리인상에 신중" - 뉴시스 2016.06.29

<http://news.naver.com/main/read.nhn?mode=LSD&mid=shm&sid1=101&oid=003&aid=0007318699>

- WSJ에 따르면 파월 이사는 "세계 경제가 좀더 하향 움직임을 보일 위험이 있다. 영국의 브렉시트 결정은 미국 경제뿐만 아니라 세계 경제 전체에 역풍이 될 수 있다"고 언급
- 금리 추가 인상을 서두르지 않을 것임을 시사
- 미 연준은 이달 초 올해 안에 미 금리가 또 한 차례 0.5%포인트 인상될 것으로 예상한다고 말했지만 영국의 브렉시트 결정은 이러한 계획이 백지화될 가능성을 부름

2. 전일 장중 동향

1) 한국채권

한국 채권 시장은 강세 출발 후 좁은 폭에서 등락을 반복하다 장중 고점 부근에서 장이 마감. 브렉시트 쇼크로 패닉을 보여주던 시장이 많이 안정된 모습. 아직은 브렉시트의 영향이 조금 남아있는 가운데 시장은 강세 기조를 유지하는 중이지만, 이달 예정되어있는 이벤트의 확인이 필요하다는 반응. 장기물이 상대적인 강세를 보이며 커브는 플랫.

2) 원화 IRS/CRS

IRS 시장은 6개월물을 제외한 전구간 0.25-1.5bp 하락 마감. 선물 대비 약세로 장이 마감되었으며 장기물이 상대적 강세를 보임에 따라 커브 역시 플랫. 어제 발표된 금통위 의사록은 시장에 큰 영향을 미치지 못했고 시장은 다음 이벤트 결과를 기다리는 모습.

CRS 시장은 1년물만 0.5bp 상승, 다른 테너는 0.5-2.0bp 하락하며 마감. 5년 CRS 이상에서 오퍼가 강세를 보였고, 커브는 볼플랫. 에셋 스왑 물량의 영향을 받으며 레벨이 전체적으로 하락.

국내 주요 금리			BOND SWAP SPREAD		
3y	1.238%	(-1.0bp)	3y	-6.0bp	(-0.2bp)
5y	1.284%	(-1.7bp)	5y	-9.9bp	(-0.8bp)
10y	1.459%	(-2.7bp)	10y	-19.2bp	(-0.6bp)
CD	1.370%	(0bp)			
IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.2425%	(-0.25bp)	1*2Y	-4.50	(0)
2Y	1.1975%	(-0.25bp)	2*3Y	-1.25	(-0.25bp)
3Y	1.1850%	(-0.5bp)	2*5Y	0.25	(-0.75bp)
5Y	1.2000%	(-1.0bp)	3*5Y	1.50	(-0.5bp)
7Y	1.2325%	(-1.5bp)	5*7Y	3.25	(-0.5bp)
10Y	1.2850%	(-1.5bp)	5*10Y	8.50	(-0.5bp)