

뉴욕증시 - 브렉시트·경기 둔화 우려에 5일만에 하락 반전 ...다우 0.61% ↓

1. 영국, 부동산 펀드 판매 중단 ...브렉시트 이후 판매 늘어나 유동성 부족 때문
2. 국제유가, 세계 경기둔화 우려 ↑ 급락 ...WTI 4.9% ↓
3. 美 경기지표 부진
 - * 5월 공장주문 (MoM) 1.8% → -1.0% (예상:-0.9%)
4. 윌리엄스 샌프란 연은 총재 "미 고용 성장세 여전히 매우 좋다"
 - * 더들리 뉴욕연은 총재 "브렉시트 따른 미 경제 영향 가늠하기 이르다"
5. BOE 총재, 브렉시트 충격 확고해져...금융 안정성 강화 노력
 - ...은행 경기대응자본확충비율 0.5% → 0%로 낮춰
 - * 브렉시트 우려 재점화 파운드 31년 최저 ...엔화 급등
 - * 피치, 브렉시트 따른 경제 둔화로 영국 자동차업 타격
6. 유럽증시, 다시 커진 브렉시트 우려에 혼조 ...英 경기부양책에 ↑

국제 증시			국제 상품		
DOW30	17840.62	(-0.61%)	WTI	46.60	(-4.9%)
NASDAQ	4822.90	(-0.82%)	COMEX금	1358.70	(+1.5%)
S&P500	2088.55	(-0.68%)	COMEX구리	2.1815	(-1.51%)
KOSPI	1989.85	(-0.27%)	주요 국가 10y국채		
KOSDAQ	692.73	(+0.67%)	한국	1.421%	(+0.6bp)
국제 통화			미국	1.38%	(-6.9bp)
유로/달러	1.1075	(-0.0061)	영국	0.77%	(-6.1bp)
유로/엔	112.60	(-1.60)	독일	-0.19%	(-4.4bp)
달러/엔	101.70	(-0.76)	프랑스	0.13%	(-2.9bp)
달러/위안	6.6594	(+0.0122)	이탈리아	1.26%	(+1.5bp)
원/달러	1155.40	전일 1146.90	스페인	1.18%	(+4.0bp)
NDF	1159.50 / 1160.00원	3.85원 상승	그리스	7.75%	(+5.9bp)

금일 예정 지표			
국가	경제지표	Previous	Forecast
[6월 FOMC의사록]			
미국	-6월 ADP비농업고용변동	173K	160K
	-5월 무역수지	-37.40B	-40.00B
	-6월 Markit종합PMI	51.2	
	-6월 서비스PMI	51.3	51.5
	-6월 ISM비제조업PMI	52.9	53.3
독일	-5월 공장주문(MoM)	-2.0%	1.0%

<2016년 7월 6일 시황>

1. 주요 뉴스

호주 중앙은행 정책금리 1.75%로 동결...'정국 혼란' 감안 - 뉴시스 2016.07.05

<http://news.naver.com/main/read.nhn?mode=LS2D&mid=shm&sid1=101&sid2=262&oid=003&aid=0007330895>

- 호주 중앙은행인 준비은행(RBA)은 5일 정책금리를 1.75%로 동결
- 영국의 유럽연합(EU) 탈퇴(브렉시트) 결정에 따른 충격을 지켜봐야 한다는 판단이 정책금리의 동결로 이어졌다는 분석

미국채수익률 곡선 '평탄화'..."주식 랠리 길지 않을 것" - 뉴스1, 2016.07.05

<http://news.naver.com/main/read.nhn?mode=LS2D&mid=shm&sid1=101&sid2=262&oid=421&aid=0002149122>

- 주가도 채권가격도 상승..."정반대의 경제전망 반영"
- 지난주 S&P500지수가 3.5% 오르고 FTSE100지수도 브렉시트로 초래된 낙폭을 모두 만회
- 이와 동시에 국채에 투자자들이 몰려들며 미국 10년물, 30년물 국채 금리는 사상 최저점에 도달

브렉시트로 EU 장기예산 72조원 구멍 - 아시아경제 2016.07.05

<http://news.naver.com/main/read.nhn?mode=LS2D&mid=shm&sid1=101&sid2=262&oid=277&aid=0003781241>

- 지난해 EU 예산에서 영국의 비중은 12.6%로 독일(21.4%) 프랑스(15.7%)에 이어 28개 회원국 중 세 번째로 순기여분 금액 부담이 컸음
- 지난주 영국 하원이 공개한 보고서에서 2016~2020년 기간 동안 영국이 유럽연합(EU) 예산에 기여할 것으로 추산한 순기여분 액수는 475억파운드(약 72조5557억원)
- 영국의 이탈로 2020년까지 장기 예산 계획에도 차질을 빚을 수 밖에 없는 상황이 됐으며 이는 향후 EU 경제성장에도 결정적인 걸림돌이 될 수 있음

파운드-달러, 31년래 최저로 추락 - 연합인포맥스 2016.07.05

<http://news.einfomax.co.kr/news/articleView.html?idxno=230580>

- 다우존스는 팩트셋을 인용해 파운드-달러 환율이 장중 1.3114달러까지 밀렸다고 31년래 최저라고 전함
- 브렉시트(영국의 유럽연합 탈퇴) 충격 이후 잦아들었던 불안감이 다시 고개를 들면서 파운드화 가치가 떨어진 것으로 풀이



2. 전일 장중 동향

*KTB: 시가 111.11 / 종가 111.09

*LKT: 시가 133.46 / 종가 133.27

1) 국내 채권 동향

국고채 금리는 5일 수익률 곡선이 스텝되며 마감. 국고채 스프레드가 너무 많이 좁아짐에 따라 금일 국채 30년물 입찰이 저조 했고, 이에 투자심리가 악화됨에 따라 강세 출발했던 시장은 약세 반전. 최근 강세를 이어왔던 장기물의 레벨 부담이 심해지며 단기물이 상대적으로 주목을 받음. 당분간 국내 이벤트 부재가 이어지므로 해외 동향에 국내 채권 시장도 연동될 것으로 전망.

2) 원화 IRS/CRS

IRS 금리는 강보합으로 마감. 초반 국채 선물이 강세 출발하며 IRS 시장도 연동되는 분위기. 역외 기관들간의 거래가 많이 형성되는 모습. 소폭 강세에 좁은 레인지에서 등락을 반복하던 시장은 국채 30년물 입찰이 저조한 성적을 내자 약세 반전. 다만, 선물 시장 종료 후 IRS는 오히려 오픈 강세로 시장이 돌아서며 금리가 소폭 하락한채 장을 마감.

CRS 시장은 오늘도 한산한 모습을 보임. 장 초반 스프레드 오픈가 나오며 커브가 플랫되었으나, 오후 반발성 비드가 나왔으나 거래가 체결되진 않음. CRS는 1년물이 레벨 부담에 상승한 FX 스왑의 영향을 받으며 2bp 상승, 커브는 불플랫. 역시 재료 부재에 당분간 관망세가 이어질 전망.

국내 주요 금리			BOND SWAP SPREAD		
3y	1.217%	(-0.6bp)	3y	-5.0bp	(+0.7bp)
5y	1.267%	(+0.1bp)	5y	-9.2bp	(-0.1bp)
10y	1.421%	(+0.6bp)	10y	-16.9bp	(-0.9bp)
CD	1.370%	(0)			

IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.2275%	(-0.25bp)	1*2Y	-4.75	(+0.25bp)
2Y	1.1800%	(0bp)	2*3Y	-1.25	(0bp)
3Y	1.1675%	(0bp)	2*5Y	-0.50	(0bp)
5Y	1.1675%	(0bp)	3*5Y	0.75	(0bp)
7Y	1.1950%	(-0.75bp)	5*7Y	2.00	(-0.75bp)
10Y	1.2525%	(-0.25bp)	5*10Y	7.75	(-0.25bp)