

뉴욕증시 - S&P·다우 '역대 최고' ...나스닥도 올 첫 5000 돌파

1. 영국 브렉시트에 따른 세계 불확실성 완화 ...세계 중앙은행의 추가 경기 부양책 기대감
2. 전일 알코아 실적 호조 ...다른 기업들 실적 기대 높아져
3. 국제유가, 저가매수·美 재고 감소 전망에 4.56% 급등
* OPEC "브렉시트, 유럽 원유 수요 위험 야기"
4. 블라드 세인트루이스 연은 총재, 2018년까지 금리 한번 인상 견해 유지
* 5월 JOLT구인건수 5.845M → 5.500M (예상:5.700M) ...예상 하회
* 5월 도매재고 (MoM) 0.7% → 0.1% (예상:0.2%) ...예상 하회
* 6월 NFIB소기업낙관지수 93.8 → 94.5 (예상:94.1) ...지난해 11월 이후 최고
5. 美 경기지표 혼조
6. 유럽증시, 美 증시 호조·경기부양 기대감에 나홀로 ↑
* BOE, 의회서 브렉시트 사전 위험 경고 '옳았다' 자기방어
7. 아베, 경기 부양 패키지 준비 공식 지시 <日經>
..."日 헬리콥터 머니 실현 기대감 아직 크지 않아" <日經>

국제 증시			국제 상품		
DOW30	18347.67	(+0.66%)	WTI	46.80	(+4.56%)
NASDAQ	5022.82	(+0.69%)	COMEX금	1335.30	(-1.6%)
S&P500	2152.14	(+0.70%)	COMEX구리	2.2130	(+3.05%)
KOSPI	1991.23	(+0.14%)	주요 국가 10y국채		
KOSDAQ	699.40	(+0.31%)	한국	1.388%	(+0.8bp)
국제 통화			미국	1.51%	(+8.0bp)
유로/달러	1.1060	(+0.0004)	영국	0.83%	(+7.0bp)
유로/엔	115.76	(+2.12)	독일	-0.09%	(+7.8bp)
달러/엔	104.66	(+1.89)	프랑스	0.19%	(+7.0bp)
달러/위안	6.6950	(+0.0107)	이탈리아	1.22%	(+2.3bp)
원/달러	1148.00	전일 1146.70	스페인	1.17%	(+1.8bp)
NDF	1144.00 / 1145.00원	4.05원 하락	그리스	7.69%	(+2.2bp)

금일 예정 지표			
국가	경제지표	Previous	Forecast
[Beige Book]			
미국	-6월 수출가격지수 (MoM)	1.1%	0.4%
	-6월 수입가격지수 (MoM)	1.4%	0.5%
중국	-6월 무역수지 (USD)	49.98B	46.64B
	-6월 수출 (YoY)	-4.1%	-4.1%
	-6월 수입 (YoY)	-0.4%	-5.0%
유로존	-5월 산업생산 (MoM)	1.1%	-0.8%

1. 주요 뉴스

1.1. 6월 수출입물가 전월비 두 달 연속 상승...유가 영향

<http://m.news.einfomax.co.kr/news/articleView.html?idxno=231449>

- '6월 수출입물가지수'에 따르면 6월 수입물가는 국제유가 상승의 영향으로 광산물 및 석탄 및 석유 제품 등이 올라 전월대비 0.7% 상승했고, 전년동월대비 4.9% 하락
- 국제유가는 두바이유 기준으로 배럴당 월평균 5월 44.26달러에서 6월 46.30달러로 전월대비 4.6% 상승

1.2. 아베, 경기 부양 패키지 준비 공식 지시<日經>(

<http://m.news.einfomax.co.kr/news/articleView.html?idxno=231423>

- 아베 총리는 이날 오후 관저에서 이시하라 노부테루 경제재생 담당상에게 디플레이션 탈피와 경제 회복을 위한 이달 말까지 경제 대책을 검토하라고 지시
- 이번 경제 대책은 약 10조엔 규모에 달할 것으로 예상

1.3. 피치 "수익률 곡선 평탄화, 미국 은행권 수익성 압박"

<http://m.news.einfomax.co.kr/news/articleView.html?idxno=231274>

- 저금리 장기화에 대한 기대와 수익률 곡선 평탄화 때문에 올해 하반기에 순이자수익(NIM)이 줄거나 매출 성장성이 둔화하는 것을 경험할 것이라고 영국 신용평가사 피치가 11일 진단
- 은행들은 저금리 환경 덕분에 미국 소비자들의 대출 연장 수요로 NIM의 증가를 겪을 수 있지만, 이는 수익률 곡선 평탄화에 따른 하락압력을 상쇄하기에는 충분치 않다"고 강조

2. 전일 장중 동향

*KTB: 시가 111.08 / 종가 111.11

*LKT: 시가 133.55 / 종가 133.64

1) 국내 채권 동향

국채 금리는 미국 시장과 연동하여 소폭 상승 마감. 일본 양적완화 정책 및 글로벌 증시 상승에 영향을 받음. 한국에서도 위험자산 선호도가 올라갔고, 외국인인 국채 3년과 10년 선물 모두 매도세에 나섬. 다만, 코스피 시장이 타국만큼의 강세를 보이지 못해 약세는 제한. 예정되어 있는 금통위와 글로벌 정책등에 대해 시장 참가자들은 관망세에 나섰으며, 금통위 이전까지는 글로벌 가격 변동에 따라 방향성이 결정될 전망.

2) IRS/CRS 동향

IRS 금리는 채권 시장과 연동하여 상승 마감. 여전히 10년 이상의 초장기물에서 오퍼 강세가 이어지며 10*20년 스프레드는 1.25 마감. IRS 시장 역시 글로벌 위험자산 선호 현상에 동조, 장기물을 제외하고는 시장 전체가 오퍼를 찾는 분위기. 장 마감 이후 스크린 위에서 비드 강세가 이어졌고, 금통위 이전까지 글로벌 자산 가격 변동에 따라 움직임이 있을 것으로 보임.

CRS 금리는 크게 상승 마감. 부채 스왑 물량에 따른 페이가 강세를 보이며 금리가 동반 상승. 또한, 장기 CRS도 외은에서 페이가 나오며 커브 또한 스팀. 특히 오후에 거래가 집중되었으며, 당분간은 부채 스왑 물량에 따라 CRS 금리가 움직일 것으로 보임.

국내 주요 금리			BOND SWAP SPREAD		
3y	1.217%	(+0.4bp)	3y	-4.0bp	(+0.4bp)
5y	1.239%	(+0.3bp)	5y	-6.7bp	(+0.2bp)
10y	1.388%	(+0.8bp)	10y	-16.1bp	(+0.2bp)
CD	1.370%	(0)			
IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.2325%	(+0.25bp)	1*2Y	-4.50	(+0.25bp)
2Y	1.1875%	(+0.5bp)	2*3Y	-1.00	(+0.25bp)
3Y	1.1775%	(+0.75bp)	2*5Y	-1.50	(0)
5Y	1.1725%	(+0.5bp)	3*5Y	-0.50	(-0.25bp)
7Y	1.1825%	(+1.0bp)	5*7Y	1.00	(+0.5bp)
10Y	1.2275%	(+1.0bp)	5*10Y	5.50	(+0.5bp)