

S&P·다우 역대 최고치 행진 지속...나스닥만 0.34% ↓**1.글로벌 증시**

* <뉴욕 마감> S&P·다우 역대 최고치 행진 지속...나스닥만 0.34% ↓

- 영국과 일본의 정치적인 긴장 완화와 세계 중앙은행들이 영국의 브렉시트 결정 후 추가 부양책을 발표 기대 등이 투자 심리에 긍정적

-美 경제지표

6월 수출가격지수(MoM) 1.2% → 0.8% (예상:0.4%)

6월 수입가격지수(MoM) 1.4% → 0.2% (예상:0.5%)

* <유럽 마감> 차익 실현+유가 급락에 닷새 만에 하락 반전

* <상하이 마감> 조정 압력에도 상승...0.37% ↑

* <도쿄 마감> 부양책 기대로 사흘째 랠리...0.84% ↑

DOW30	18372.12	(+0.13%)...또 다시 사상 최고치
NASDAQ	5005.73	(-0.34%)
S&P500	2152.43	(+0.01%)...사흘째 역대 최고치 행진
NIKKEI225	16231.43	(+0.84%)
SHANGHAI	3060.69	(+0.37%)
FTSE100	6670.40	(-0.15%)
DAX30	9930.71	(-0.33%)
CAC40	4335.26	(+0.09%)

2.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가, BOE 등 세계 통화완화 기대로 상승 재개

- 국채가격은 30년물 국채 입찰을 앞두고 있음에도 연일 최고치를 경신하던 뉴욕증시의 상승 탄력 둔화+이들 연속 가격 하락에 따른 저가 매수세 등장+시장 기대보다 부진한 수입물가 오름세 등으로 상승 출발

* 독일 10년 국채 첫 마이너스 금리 발행...'비용절감'

- 처음으로 40억3천800만유로어치의 10년 만기 국채를 마이너스(-) 금리인 -0.05%에 발행 <다우존스>

- 이날 유통시장에서 10년 만기 독일 국채는 전일보다 4.4bp 하락한 -0.146%로 사상 최저치 근접

[미국]

2y 0.67% (-2.4bp)

10y 1.47% (-3.6bp)

30y 2.17% (-5.2bp)

[기타]

영국 0.74% (-8.4bp)

독일 -0.09% (-5.6bp)

프랑스	0.15%	(-4.4bp)
이탈리아	1.20%	(-1.8bp)
스페인	1.14%	(-2.6bp)
그리스	7.68%	(-0.8bp)

3.글로벌 환시

- * 달러, 증시 부진에 위험선호도 하락하면서 약세
- 투자자들의 리스크 선호도가 감소 때문
- 캐나다 중앙은행이 기준금리를 동결한 것도 달러에 악재

유로/달러	1.1088	(+0.0028)
유로/엔	115.86	(+0.10)
달러/엔	104.47	(-0.19)
달러/위안	6.6891	(-0.0059)

4.글로벌 상품

- * <뉴욕 유가> 국제유가, IEA 공급과잉 경고에 급락...WTI 4.4% ↓
- IEA 월간 시장 보고서, 지난 6월 중동 국가들의 일일 원유 생산량이 3321만배럴에 달하며 2008년 7월 이후 최고치 기록
- 같은 기간 미국 산유량이 이전보다 14만배럴 줄은 1245만배럴을 기록한 것과 대조적
- * <뉴욕 금가격> 초저금리 지속 전망 등에 0.6% 상승
- 시간외 거래에서 1344달러 돌파
- * 中 상품선물시장, 또다시 '들쭉'
- 브렉시트 이후 투기꾼들이 각국 중앙은행의 통화완화 가능성을 예상하며 금과 은을 비롯한 귀금속, 철광석, 설탕, 계란 등 농산물 등 상품거래에 다시 몰리는 모습.
- 특히 철광석, 철근을 대표로 하는 흑색금속의 반등과 안전자산인 황금이 전체 상품선물시장의 거래량 확대 유도.

WTI	44.75	(-4.40%)
COMEX금	1343.60	(+0.60%)

5. 전일 국내 지표

코스피	2,005.55	(+0.72%)
코스닥	702.65	(+0.46%)
원/달러	1146.40,	전일(1148.00원)
NDF,	1,146.00/1,147.00원	...0.40원 하락
KTB: 시가	111.04	/ 종가 111.13
LKTb: 시가	133.20	/ 종가 133.56

6. 전일 국내 주요 금리: 국내 채권 시장은 미국채 금리 상승에 연동, 상승 출발. 그러나 외인이 3년 및 10년 국채선물 순매수에 나서며 금리는 혼조세. 금통위 대기에 장기물은 강세폭 제한.

3y	1.211%	(-0.6bp)
5y	1.237%	(-0.2bp)
10y	1.393%	(+0.5bp)
CD	1.360%	(0bp)

7. 본드-스왑 스프레드

3y	-3.4bp	(+0.6bp)
5y	-6.0bp	(+0.7bp)
10y	-16.1bp	(0bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS : IRS 금리는 채권 시장과 연동하여 약세 출발하였으나, 금통위 대기 및 외인 국채 선물 순매수에 장중 강세 반전. 그러나 내일 예정되어 있는 금융통화위원회 경계감에 강세폭 또한 제한되며 금리는 혼조세를 보임. 6개월물은 0.5bp 하락, 10년 이상 구간은 0.5bp 상승하며 커브는 베어스텝.

IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.2300%	(-0.25bp)	1*2Y	-4.25	(+0.25bp)
2Y	1.1875%	(0bp)	2*3Y	-1.00	(0bp)
3Y	1.1775%	(0bp)	2*5Y	-1.00	(+0.50bp)
5Y	1.1775%	(+0.50bp)	3*5Y	0.00	(+0.50bp)
7Y	1.1850%	(+0.25bp)	5*7Y	0.75	(-0.25bp)
10Y	1.2325%	(+0.50bp)	5*10Y	5.50	(0bp)

* CRS : CRS 금리는 최근의 상승세를 이어가는 분위기. 부채 스왑 관련 물량에 비드가 강세를 보이며 주로 5년 이상 중장기물 위주로 거래. 금리는 전체적으로 0.5-3.0bp 상승하며 전체적인 수익률 곡선은 스티프닝이 진행됨. CRS 시장 역시 금통위 경계감에 거래량은 제한.

CRS OUTRIGHT			CRS SPREAD		
1Y	1.1000%	(+0.50bp)	1*2Y	-19.50	(+2.50bp)
2Y	0.9050%	(+3.00bp)	2*3Y	-5.50	(0bp)
3Y	0.8500%	(+3.00bp)	2*5Y	-12.00	(-0.50bp)
5Y	0.7850%	(+2.50bp)	3*5Y	-6.50	(-0.50bp)
7Y	0.7900%	(+2.00bp)	5*7Y	0.50	(-0.50bp)
10Y	0.7650%	(+2.50bp)	5*10Y	-2.00	(+0.50bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 브렉시트, 일부 지역 경제전망에 부정적 영향 <연준 베이지북>

- 브렉시트가 일부 지역에서 기업들의 우려를 야기했다고 진단.
- 다만, 12개 관할 구역에서 전반적으로 보통수준의 완만한 경제 성장세 나타나

* 카플란 델러스연은 총재, 완화적 통화정책 벗어나는 데 인내심 필요

- 점진적인 속도로 인내심을 가지고 경기 조절적인 통화정책 벗어나야
- 다음 기준금리 인상 시기와 금리 인상 횟수를 추측하는 것은 현명하지 않다고 부연.
- 브렉시트에 따른 즉각적인 여파는 이미 지나갔다고 평가.

* 캐나다중앙은행, 기준금리 0.5%로 동결

- 수출 둔화와 약한 투자 전망으로 경제 성장 전망치를 하향 조정함에 따라 금리 동결을 결정.
- BOC는 기업들의 투자 계획이 악화했고 최근 몇 달 동안 수출 지표도 예상보다 약한 수준이었다고 평가.

* 돔브레 독일중앙은행 이사 "런던 유로청산업 프랑크푸르트로 넘어올 것"

- 브렉시트가 270억 달러 규모의 독일 프랑크푸르트증권거래소와 런던증권거래소 합병 필요성에 강한 근거를 제시.

* 日재무성 "오는 15일 미쓰비시UFJ은행 국채 PD서 제외"

- 미쓰비시도쿄UFJ은행은 지난달 초 PD 자격을 반납하겠다는 방침을 재무성에 전달. 일본은행의 마이너스 금리 정책 도입으로 국채 의무입찰 부담이 가중되자 PD 자격 포기 결정.

[국내]

* 6월 취업자 35.4만 명 ↑...실업률 3.6%

- 청년실업률은 10.3%로 6월 기준으로 역대 최고치
- 조선업 구조조정 여파로 경남지역 실업률 증가폭이 가장 컸음

* 기재부 "취업자 증가폭 회복...제조업, 부진 심화"

* 당정, 15일에 추경 가이드라인...유일호 부총리 참석

* 국회 "적자성 국가채무 확대...국고채 발행 규모 관리"

* SC제일 "韓, 하반기 추경?금리인하...환율 1,200원"

금일 예정 지표

[금통위]

[BOE 금리결정 & 통화정책위원회 의사록]

미국-신규실업수당청구건수 (이전:254K, 예상:265K)

-6월 PPI(MoM) (이전:0.4%, 예상:0.3%)

-6월 근원PPI(MoM) (이전:0.3%, 예상:0.1%)

한국-7월 금융통화위원회 기준 금리 결정 (현재:1.25%, 예상:1.25%)