뉴욕증시 – 실적부진에 '소비' 우려↑...3대 지수 급락

1. 디즈니 & 백화점 체인 메이시스의 실적 부진 ...각 4% & 15% 주가 하락
  * 스테이플스, 경쟁사 오피스디포 인수 실패로 주가 18% 하락
2. 국제유가, 美 원유재고 감소에 급등 ...WTI '6개월 최고'
3. 유럽증시 사흘 만에 하락 ...차익실현 + 은행주↓
4. 구로다 총재 "BOJ 필요시 실제 통화완화 가능"
5. 3월 OECD 경기선행지수 하락 ...99.7 → 99.6

국제 증시		
DOW30	17711.12	(-1.21%)
NASDAQ	4760.69	(-1.02%)
S&P500	2064.46	(-0.96%)
KOSPI	1980.10	(-0.12%)
KOSDAQ	703.94	(+0.53%)
국제 통화		
유로/달러	1.1425	(+0.0054)
유로/엔	123.87	(-0.38)
달러/엔	108.40	(-0.83)
달러/위안	6.5209	(-0.0024)
원/달러	1167.60	전일 1172.60
NDF	1166.00 / 1167.00원	1.90원 하락

국제 상품		
WTI	46.23	(+3.5%)
COMEX금	1275.50	(+0.9%)
COMEX구리	2.1010	(+0.53%)
주요국가 10y국채		
한국	1.765%	(-0.3bp)
미국	1.74%	(-2.5bp)
영국	1.39%	(-1.1bp)
독일	0.12%	(+0.2bp)
프랑스	0.48%	(-1.1bp)
이탈리아	1.47%	(-3.4bp)
스페인	1.59%	(-3.7bp)
그리스	7.30%	(-18.3bp)

금일 예정 지표

국가	경제지표	Previous	Forecast
미국	-신규실업수당청구건수	274K	270K
	-4월 수출물가지수 (MoM)	0.0%	0.1%
	-4월 수입물가지수 (MoM)	0.2%	0.5%
유로존	-3월 산업생산 (MoM)	-0.8%	0.1%

1.전일 장중 동향

*KTB : 시가 110.47 / 종가 110.45
*LKTB : 시가 129.63 / 종가 129.73

1)국고 3년 지표물인 15-7호는 전일 대비 0.3bp 상승한 1.415%에 거래를 시작. 국고 10년 지표물 15-8호도 전일과 같은 1.768%로 출발. 10년 만기 미국채 금리가 보합세를 보이면서 국내 금리 레벨 부담이 부각됨.
-외인의 국채선물 매수에 강보합으로 시작한 국고채 금리는 좁은 박스권에서 강보합과 약보합을 오가며 등락함. 외인은 10년 국채선물 위주로 매수에 나섰지만, 레벨 부담에 보합세를 벗어나지 못함.
-장 중 특별한 방향성 없이 횡보하던 국고채 금리는 결국 보합권에서 마감. 국고채 3년물 금리는 금통위를 앞두고 금리 레벨에 부담을 느낀데다, 외인의 미약한 3년 국채선물 매수세에 상승함.
-국고채 10년물 금리는 외인이 10년 국채선물을 순매수한 영향에 소폭 하락 마감. 장단기 국채선물 역시 보합권에서 혼조세로 마무리됨. KTB의 장중 고점과 저점의 차이는 5틱에 불과했음.

2)IRS 금리는 장기 구간만 소폭 하락. 1년과 2년 IRS는 각각 1.4275%, 1.3725%를 기록하며 전일과 변화가 없었음. 3년부터 10년까지는 모두 0.5bp 떨어져 만기별로 3년 1.3875% 5년 1.4425% 10년 1.5925%를 나타냄.
-국제유가가 왔다갔다하는 형세고 아시아 증시도 우리나라와 일본, 중국이 다 방향성이 달랐음. 스왑 시장 전반에서 특별한 수급이 나오진 않음.

3)CRS는 단기 구간을 중심으로 에셋 스왑 물량이 나와 그 영향을 받았음. 대외에서 안전자산 선호도가 크게 변하거나 이달 금통위에서 예상치 못한 수준으로 방향성이 갈려야 시장이 크게 움직일 것으로 예상됨.

국내 주요 금리			BOND SWAP SPREAD		
3y	1.417%	(+0.5bp)	**3y**	-3.0bp	(-1.0bp)
5y	1.520%	(-0.1bp)	**5y**	-7.8bp	(-0.4bp)
10y	1.765%	(-0.3bp)	**10y**	-17.3bp	(-0.2bp)
CD	1.600%	(-1.0bp)			

IRS OUTRIGHT			IRS SPREAD		
1Y	1.4275%	(0)	**1*2Y**	-5.50	(0)
2Y	1.3725%	(0)	**2*3Y**	1.50	(-0.5bp)
3Y	1.3875%	(-0.5bp)	**2*5Y**	7.00	(-0.5bp)
5Y	1.4425%	(-0.5bp)	**3*5Y**	5.50	(0)
7Y	1.5025%	(-0.5bp)	**5*7Y**	6.00	(0)
10Y	1.5925%	(-0.5bp)	**5*10Y**	15.00	(0)