

국제금융시장 동향 (일보)

(2022년 6월 15일 수요일)

연준 '자이언트 스텝' 우려...국채 ↓ 주가 혼조

▷ 미국채 기간별 수익률(%)

기간	6.14	6.13	등락(bp)	연초	시황요약
2 y	3.432	3.358	+7.4	0.770	<div>□ 미 국채수익률 : 2년물 7.4bp ↑, 5년물 10.5bp ↑, 10년물 11.1bp ↑</div> <div>- CPI 급등 이후 연준이 앞으로 얼마나 금리를 높게 인상할지에 대한 불확실성이 커진 가운데, 채권시장 참가자들이 75bp 인상 가능성에 무게를 실으면서 채권가격 급락세 지속</div> <div>- 강한 긴축정책에 대한 기대로 전일 집중됐던 채권 매도세가 오전에 잠시 가라앉았지만, 75bp 인상을 예상하는 시장관계자들의 발언이 나오면서 투자심리가 회복되지 않음</div> <div>□ 국제유가 : WTI 배럴당 U\$118.93 (전장대비 1.65% ↓)</div> <div>- 공급 우려로 장중 123달러까지 상승하였으나 미 민주당에서 석유 기업들이 벌어들인 초과 이익에 대해 연방세를 물리는 방안을 제안할 것이라는 소식에 하락</div>
3 y	3.593	3.488	+10.5	1.019	
5 y	3.591	3.483	+10.8	1.356	
10 y	3.476	3.365	+11.1	1.630	
30 y	3.427	3.350	+7.7	2.026	

※ Swap spread : (2Y) 36.8(-1.83), (3Y) 16.51(-2.54), (5Y) 4.68(1.96), (10Y) 6.58(-0.48), (30Y) -27.41(-2.47)

▷ 정부 채권 가산금리(bp)

발행자(신용등급)	만기	발행시	쿠폰금리	6.14	6.13	등락(bp)	연초
정부 (Aa2/AA)	'31. 10	T10+25	1.750	T10+37 (S+58)	T10+35 (S+54)	+2.0	T10+18 (S+37)

▷ CDS Spread(5년, bp)

발행자(신용등급)	6.14	6.13	전일비(bp)	연초	연초비(bp)	연저점	연고점
정부 (Aa2/AA)	52	52	-	21	+31.0	21	52
KEXIM (Aa2/AA)	51	46	+5.0	22	+29.0	21	51

※ 최근 5년내 정부 5Y CDS : 최저 '21.09월 17.455 / 최고 '17.09월 75.82 (역대 최고치 '08.10월 692)

▷ 주요국 환율 및 주가

국가	6.14	전일비	연초비(%)	종목	6.14	전일비	연초비(%)	시황요약
₩/U\$	1,286.45	+2.2	+8.1%	Dow	30,365	△151.9	△16.4%	<div>□ 증시 : FOMC를 하루 앞두고 공격적 긴축 우려에 혼조세</div> <div>- 다우 0.50% ↓, S&P 0.38% ↓, 나스닥 0.18% ↑</div> <div>□ 환율 : 미 달러화 연준의 공격적 금리인상 우려에 대체로 강세</div> <div>- 달러 인덱스, 전장 대비 0.28% 오른 105.488 기록 (20년 내 최고치)</div>
¥/U\$	135.47	+1.1	+17.7%	NIKKEI	26,630	△357.6	△7.5%	
U\$/£	1.1997	△0.0	△11.3%	FTSE	7,187	△18.4	△2.9%	
U\$/€	1.0416	+0.0	△8.4%	STOXX	3,475	△27.3	△19.3%	
₩/€	1,344.74	△2.3	△0.1%	KOSPI	2,493	△11.5	△16.3%	
₩/¥	9.50	△0.1	△8.2%	SHCI	3,289	+33.4	△9.1%	
CNY/U\$	6.7410	△0.0	+6.1%	HSI	21,068	+0.4	△10.0%	

▷ 주요 이벤트 일정

- FOMC 회의(6.14~6.15), 소매판매 추정 전월비, MBA 주택융자 신청지수(6.15), 신규 실업수당 청구건수(6.16), 광공업생산 MoM(6.17)