

1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 9월 FOMC 정례회의에서 연준의 비둘기 성향이 확인된 영향이 이어져 상승

- 개장초 고점 매도세로 오름폭을 줄이며 출발했다가 제조업 지표 발표 후 다시 확대하는 등 좁은 폭에서 오락가락했다

- 10년물 수익률은 9월 한 달 동안 ECB가 촉발한 세계 중앙은행의 통화완화 정책 한계 우려와 가격 고평가 논란으로 매도세가 시작되면서 1.752%까지 상승하였으나 최근 사흘간 9월 FOMC 정례회의에서 연준의 느린 금리 인상 기조와 BOJ의 양적완화 유지가 재확인되자, 10년물 국채수익률은 1.72%에서 1.60%로 하락

- 10년물 수익률, 이번주 8.6bp 빠지면서 지난 7월 29일 이후 가장 큰 주간 낙폭 기록

[미국]

2y 0.75% (-1.6bp)

10y 1.62% (+0.0bp)

30y 2.35% (+1.2bp)

[기타 10Y물]

영국 0.73% (+2.4bp)

독일 -0.08% (+1.4bp)

프랑스 0.21% (+1.3bp)

이탈리아 1.21% (+2.5bp)

스페인 0.96% (+4.9bp)

그리스 8.23% (-3.5bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 유가 급락 & 애플 주가 하락등의 영향으로 에너지주 타격

- 국제유가 4% 급락

사우디 "알제리 회동, 의사결정 아닌 대화의 장... 산유량 동결 합의 없을것"

- 에너지주, 유가 급락 영향으로 1.25% 하락

- 애플 주가는 리서치 회사인 GfK가 아이폰7 판매에 대한 우려를 제기한 이후 1.67% 하락

- 美 9월 제조업 PMI 52.0-> 51.4 (예상)..지난 6월 이후 최저치

* <유럽 마감> 경제지표 부진 여파에 일제히 하락...은행주 부진도 한 몫
- 9월 서비스 PMI 52.8-> 52.1 (예상:52.8)

* <상하이 마감> 소폭 상승으로 출발한 지수는 등락 반복하다가 오후 장에서 원자재주 약세에 하락세로 마감

* <도쿄 마감> 일본과 미국의 통화 정책 결정 이후 나타난 엔화 강세 흐름을 반영해 하락

DOW30	18261.45	(-0.71%)
NASDAQ	5305.75	(-0.63%)
S&P500	2164.69	(-0.57%)
NIKKEI225	16754.02	(-0.32%)
SHANGHAI	3033.90	(-0.28%)
FTSE100	6909.43	(-0.03%)
DAX30	10626.97	(-0.44%)
CAC40	4488.69	(-0.47%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 연준의 느린 기준금리 인상 기조의 장기화 기대 속에 보험권에서 유로화에 내리고 엔화에는 오르는 혼조세

유로/달러	1.1223	(+0.0017)
유로/엔	113.20	(+0.31)
달러/엔	100.97	(+0.23)
달러/위안	6.6670	(+0.0157)
파운드/달러	1.29607	(-0.01129)
NDF	1104.80 / 1105.50원...2.35원 상승	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 사우디 산유량 동결 난망 진단에 4% 급락

* <국제 금값> 달러 강세와 차익실현 매물 영향으로 소폭 하락... 하지만 주간 기준으로는 약 2달 만에 가장 큰 폭으로 상승 (+2.4%)

WTI	44.48	(-4.0%)
COMEX금	1341.70	(-0.20%)

5. 전일 국내 지표

코스피	2054.07	(+0.21%)
코스닥	688.59	(+0.49%)
원/달러	1102.40	(-0.90)
KTB	110.81	(-0.01)
LKTb	132.26	(+0.11)

6. 전일 국내 주요 금리

* 장기 국고채 금리가 하락하면서 커브 플랫닝 지속

- 오후 1시30분 무렵 기재부가 국고채 50년물 예비입찰 결과와 11곳의 인수단을 발표하면서 일시적으로 장기물 금리가 상승하기도 했으나 이내 강보합 수준으로 되돌아감
- 단기물 금리는 국내 추가 기준금리 인하 가능성 축소와 분기말 자금 사정 악화로 보험권에 머무름. 반면 장기물 금리는 하락 마감

1y	1.3180%	(+0.10bp)
3y	1.3030%	(+0.70bp)
5y	1.3260%	(0.00bp)
10y	1.5000%	(-1.90bp)
20y	1.5220%	(-1.80bp)
30y	1.5280%	(-2.20bp)
CD	1.3400%	(0.00bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1y	-5.05bp	(-0.25bp)
2y	-6.85bp	(-0.10bp)

3y	-5.55bp	(-0.70bp)
5y	-5.35bp	(0.00bp)
10y	-16.00bp	(+1.40bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 보험권 마감. 국고채 50년물 예비입찰을 전후로 현물 움직임이 있어 장기물 변동성이 커지기도 했지만 IRS는 조용한 흐름

* CRS, 전 구간에서 고르게 하락. 장기구간을 중심으로 오퍼가 유입되면서 커브 플래트닝

*IRS 금리

1Y	1.2725%	(-0.25bp)
2Y	1.2525%	(0.00bp)
3Y	1.2475%	(0.00bp)
5Y	1.2725%	(0.00bp)
7Y	1.2900%	(0.00bp)
10Y	1.3400%	(-0.50bp)

1*2Y	-2.00	(+0.25bp)
2*3Y	-0.50	(0.00bp)
2*5Y	2.00	(0.00bp)
3*5Y	2.50	(0.00bp)
5*7Y	1.75	(0.00bp)
5*10Y	6.75	(-0.50bp)

*CRS 금리

1Y	1.1950%	(-1.00bp)
2Y	1.0500%	(-1.00bp)
3Y	1.0300%	(-1.00bp)
5Y	0.9750%	(-0.50bp)
7Y	0.9200%	(-1.50bp)
10Y	0.9000%	(-2.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 주요국 경제지표

- 유로존 9월 합성 PMI 52.9-> 52.6 (예상: 52.8)
- 독일 9월 제조업 PMI 53.6-> 54.3 (예상:53.1)...3개월만에 최고치
- 서비스업 PMI는 3개월래 최저 기록 (51.7-> 50.6...예상치 52.1 하회)

* 보스턴 연은 총재 "경기 확장이 지속하는 것을 돕기 위해 이달 기준금리 인상을 지지했다"

* 日 관방장관, 엔화 강세 지속되면 조치에 나서겠다는 입장 밝혀

'외환 시장에서 불안한 움직임이 보인다...과도한 움직임이 지속되면 필요한 대응을 하겠다'

* ECB 부총재 '연준 12월 기준금리 인상할 것을 기대한다... 이러한 움직임은 세계경제를 매우 안심시킬 것'

* 무디스, 터키 국가신용등급 투기 등급으로 강등

[국내]

* 현대상선, 한진해운 컨테이너선 인수 검토할 것<WSJ>

* 국고채 50년물 인수단 11곳...예비입찰 낙찰금리 1.610%

- 국민은행, 크레디 아그리콜 등 은행 2곳
- 대신증권, 동부증권, 미래에셋증권, 미래에셋대우증권, 메리츠증권, 삼성증권, 신한금융투자, NH투자증권, 현대증권 등 증권사 9곳

* 기재부 "국고채 50년물 예비입찰...탄탄한 수요 확인"

* 韓-EU, 브렉시트 불확실성 부작용 최소화 협력

* 국고 20년 16-6호 딜미스...오버 5.9bp에 20억 거래

주간 예정 지표

9월 26일

[구로다 BOJ 총재 연설]
[로버트 카플란 달러스 연은 총재 연설]
[닐 카시카리 미니애폴리스 연은 총재 연설]
[대니얼 타롤로 연준 이사 연설]

독일-9월 IFO 기업환경지수 (예상:106.4, 이전:106.2)
미국-8월 신규주택판매 (예상:600K, 이전:654K)

9월 27일

[BOJ 7월 금융정책결정회의 의사록]
[IMF 세계경제전망 분석보고서]

미국-7월 20대 대도시주택가격(YoY) (예상:5.1%, 이전:5.1%)
-9월 CB 소비자신뢰지수 (예상:99.0, 이전:101.1)
-9월 서비스 PMI (예상:51.2, 이전:51.0)

9월 28일

[재닛 옐런 연준 의장 미 하원 증언]
[닐 카시카리 미니애폴리스 연은 총재 연설]
[제임스 불라드 세인트루이스 연은 총재 연설]
[찰스 에번스 시카고 연은 총재 연설]

독일-8월 GfK 소비자신뢰지수 (예상:10.2, 이전:10.2)
미국-8월 내구재수주(MoM) (예상:-1.5%, 이전:4.4%)
-8월 근원내구재수주(MoM) (예상:-0.4%, 이전:1.3%)
-원유재고 (이전:-6.200M)
한국-9월 소비자신뢰지수 (이전:102)

9월 29일

[구로다 BOJ 총재 연설]

[제롬 파월 연준 이사 연설]

[로레타 메스터 클리블랜드 연은 총재 연설]

[에스더 조지 캔자스시티 연은 총재 연설]

[데니스 록하트 애틀랜타 연은 총재 연설]

일본-소매판매(YoY) (예상:-1.8%, 이전:-0.2%)

독일-9월 실업률 (예상:6.1%, 이전:6.1%)

-9월 CPI (MoM) (예상:0.0%, 이전:0.0%)

미국-2분기 GDP(QoQ) (예상:1.3%, 이전:1.1%)

-8월 펜딩주택판매(MoM) (예상:0.3%, 이전:1.3%)

-주간실업보험청구자수 (예상:260K, 이전:252K)

한국-10월 제조업 기업경기실사지수 (이전:77)

9월 30일

한국-8월 산업생산(MoM) (이전:1.4%)

-소매판매 (이전:-2.6%)

-9월 Nikkei제조업PMI (이전:48.6)

일본-8월 가계지출(MoM) (예상:-1.0%, 이전:2.5%)

-8월 근원 CPI(YoY) (예상:-0.4%, 이전:-0.5%)

-8월 CPI(YoY) (예상:-0.4%, 이전:-0.4%)

-산업생산(MoM) (예상:0.5%, 이전:-0.4%)

중국-9월 차이신 제조업 PMI (예상:50.1, 이전:50.0)

영국-2분기 GDP(QoQ) (예상:0.6%, 이전:0.6%)

유로존-8월 CPI(YoY) (예상:0.4%, 이전:0.2%)

-8월 실업률 (예상:10.0%, 이전:10.1%)

미국-8월 PCE 가격지수(MoM) (예상:0.2%, 이전:0.1%)

-8월 개인지출(MoM) (예상:0.2%, 이전:0.4%)

-9월 시카고 PMI (예상:52.5, 이전:51.5)

-9월 미시간대 소비자태도지수 (예상:90.0, 이전:89.8)