1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 도이체방크 불안이 재발하면서 안전자산 선호가 강해져 상승

- 국채가격은 개장 초 유럽과 미국의 경제지표 호조, 연준 위원들의 매파 발언으로 하락 출발 하였으나 오후 들어 도이체방크발 불안으로 뉴욕증시가 반락하는 등 안전자산 선호가 강해져 반등

- 헤지펀드들, 도이체방크 위험 노출액 줄여
밀레니엄파트너스, 카풀라인베스트먼트, 로코스캐피탈 등 약 10개의 헤지펀드, 이번 주 중에 자산을 다른 은행으로 이전

- 지역 연방준비은행 총재들, 연내 금리 인상을 지지하는 요지로 발언
필라델피아 연은 총재 '경제가 예상했던 성장세를 이어간다면 12월에 기준금리를 인상할 것'
클리블랜드 연은 총재 '기준금리 인상하는 것이 적절하며 이러한 조치가 경제 확장세를 연장할 것'
캔자스시티 연은 총재 '연준, 침착하면서도 분명하게 금리 인상을 진행해야...연준이 금리를 성급하거나 뒤늦게 올리지 않길 바란다' 강조

[미국]
2y 0.73% (-2.1bp)
10y 1.56% (-1.2bp)
30y 2.28% (-1.5bp)

[기타 10Y물]
영국 0.72% (+1.3bp)
독일 -0.12% (+2.8bp)
프랑스 0.18% (+2.8bp)
이탈리아 1.21% (+3.0bp)
스페인 0.91% (+2.0bp)
그리스 8.10% (+0.3bp)

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 도이체방크에 대한 우려로 은행주가 약세를 보인 데 따라 하락

* 도이체방크 주가, 6% 이상 내림세... 이에 따라 미국 은행주도 타격

- 골드만삭스와 JP모건이 각각 2.7%와 1.6% 하락했고 씨티그룹과 뱅크오브아메리카(BOA)가 각각 2.3%와 1.4% 하락

* 美 GDP 예상 상회... 고용호조 지속
- 2분기 GDP 1.1%-> 1.4% (예상:1.3%)
- 신규 실업수당 청구건수 251K-> 254K (예상:260K)...예상치 하회

* 그 외 美 지표 부진한 결과
- 8월 도매재고, 전월대비 -0.1%...예상치 0.0%
- 8월 잠정주택판매 지수(MoM) 1.2%-> -2.4% (예상:0.3%)

* <유럽 마감> 유가 급등 불구하고 도이체방트 우려감에 혼조세 마감

* <상하이 마감> 유가 급등 등 대외 호재에 상승

* <도쿄 마감> OPEC 호재에 에너지주 중심 랠리

DOW30	18143.45	(-1.07%)
NASDAQ	5269.15	(-0.93%)
S&P500	2151.13	(-0.93%)
NIKKEI225	16693.71	(+1.39%)
SHANGHAI	2998.48	(+0.36%)
FTSE100	6919.42	(+1.02%)
DAX30	10405.54	(-0.31%)
CAC40	4443.84	(+0.26%)

3.글로벌 환시

* 달러화, 경제지표 호조와 연준 위원들의 매파 발언으로 엔화에 올랐지만 도이체방크발 유럽 금융시스템 우려가 뉴욕증시를 강타해 유로화에는 내리는 혼조

유로/달러	1.1221	(+0.0005)
유로/엔	113.33	(+0.43)
달러/엔	101.02	(+0.34)
달러/위안	6.6700	(+0.0019)
파운드/달러	1.29644	(-0.00482)
NDF	1102.50 / 1103.20원...3.75원 상승	

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 석유수출국기구(OPEC) 회원국의 산유량 감축 호재가 지속해 상승
장중 2% 넘게 강세를 보이던 유가는 산유량 감축 규모가 시장 균형을 이끌기에 충분하지 않다는 분석이 나오며 상승 폭을 소폭 줄여

* <국제 금값> 일부 긍정적 경제지표와 연준 고위관계자들의 매파적 발언에도 도이체방크에 대한 우려가 점증해 소폭 상승
달러화가 확실한 방향성을 찾지 못함에 따라 금가격 역시 극도로 좁은 폭에서 등락을 거듭

WTI 47.83 (+1.7%)...약 1개월 만에 최고치 기록
COMEX금 1326.00 (+0.2%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2068.72 (+0.76%)
코스닥 689.83 (+0.45%)
원/달러 1098.80 (+2.00)
KTB 110.89 (+0.07)
LKTB 132.89 (+0.24)

6. 전일 국내 주요 금리

* 국고채 금리, 장중 강세 반전된 후 장중 저점 수준에서 마감. 외인의 10년 지표물 16-3호를 1천억원 이상 매수와 국고채 발행과 관련된 루머, 장 막판 숏커버로 추정되는 매수 유입이 있었음

1y 1.3270% (+0.10bp)
3y 1.2970% (-0.70bp)
5y 1.3200% (-1.50bp)
10y 1.4560% (-1.20bp)
20y 1.4940% (+0.30bp)
30y 1.4990% (-0.70bp)

CD 1.3400% (0.00bp)

7. 본드 스왑 스프레드

1Y -6.10bp (-1.05bp)
2Y -8.55bp (-0.70bp)
3Y -5.70bp (-0.55bp)
5Y -7.25bp (-0.25bp)
10Y -16.60bp (-1.80bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS, 국채선물이 장 마감 전 외인의 매수로 시장이 급등한 영향으로 하락 마감
* CRS도 소폭 하락 마감. 단기물 위주로 수익률 곡선이 눌려있는 상황 지속

*IRS 금리

1Y 1.2750% (-0.75bp)
2Y 1.2475% (-1.00bp)
3Y 1.2400% (-1.25bp)
5Y 1.2475% (-1.75bp)
7Y 1.2575% (-2.25bp)
10Y 1.2900% (-3.00bp)

1*2Y -2.75 (-0.25bp)
2*3Y -0.75 (-0.25bp)
2*5Y 0.00 (-0.75bp)
3*5Y 0.75 (-0.50bp)
5*7Y 1.00 (-0.50bp)
5*10Y 4.25 (-1.25bp)

*CRS 금리

1Y 1.1800% (-1.50bp)

2Y 1.0300% (-1.00bp)
3Y 0.9950% (-1.50bp)
5Y 0.9300% (-1.50bp)
7Y 0.8700% (-2.00bp)
10Y 0.8400% (-2.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 제롬 파웰 연방준비제도 이사 '경제가 천천히 개선됨에 따라 연준은 기준금리를 점진적으로 인상할 인내심을 가질 수 있다'

* 독일 9월 CPI 0.0%-> 0.1% (예상:0.0%)

* 유로존 경기체감지수 103.5-> 104.9 (예상:103.5)...지난 1월이후 최고치

* 골드만삭스, OPEC 감산에도 유가 전망 유지
- WTI 전망치 올해말 배럴당 $43, 내년 배럴당 $53로 기존 수준을 유지
- 감산 결정이 단기적으로 유가를 밀어올리더라도 공급량은 크게 변하지 않아 유가에 가해지는 상승 압력이 미미할 것이라는 분석

* 멕시코 중앙은행, 물가안정 위해 기준금리 4.75%로 인상 (+50bp)

[국내]

* 기재부, 10월 국고채 5.9조 발행...50년물 감안 0.6조↓

[10월 국고채 발행계획]
☞ 총 5.90조(-0.60조)

입찰일 종목 수량 통합/선

10/04(화) 3y 0.90조 통합(-0.05조)

10/04(화) 3y 0.60조 선매(-0.05조)
10/10(월) 5y 1.30조 통합(-0.10조)
10/17(월) 10y 1.05조 통합(-0.05조)
10/17(월) 10y 0.65조 선매(-0.05조)
10/24(월) 20y 0.55조 통합(-0.10조)
10/05(수) 30y 0.85조 통합(-0.20조)

☞ 국채 교환
- 일정: 10.12(수) 0.10조 10:40~11:00
- 발행: 국고16-3
- 매입: 물가7-2, 10-4, 11-4, 13-4

☞ 국채 조기상환
- 일정: 10.19(수) 1.90조 10:40~11:00
- 매입: 12-1, 12-4, 7-6, 13-1

금일 예정 지표

[제3회 Korea Treasury Bonds 국제 콘퍼런스 개최및 국고채 50년물 입찰 결과 발표 (14:10)]

한국-8월 산업생산(MoM) (예상:-0.5, 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:0.1%, 이전:0.4%)
-9월 시카고 PMI (예상:52.0, 이전:51.5)