1.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가격, 개장 초 도이체방크 우려로 오르다가 美 제조업 지표 호조가 연준의 연내 기준금리 인상 가능성을 높여 단기물 위주로 가파르게 반락
오후 들어 로레타 메스터 클리블랜드 연방준비은행 총재의 매파 발언에도 낙폭을 소폭 넓히는데 그쳤다.

단기물 위주의 수익률 상승은 美 국채의 수익률곡선을 눕게 했으며 장기물 상승폭이 상대적으로 미진한 것은 연내 기준금리가 한 차례 오르는 것으로는 장기물 수익률에 큰 영향을 끼치기 어렵기 때문이라고 풀이

- 금요일 .. 국채가격, 혼조적인 美 경제 발표 속에서 상승 출발했다가 도이체방크발 불안이 완화되면서 안전자산 선호가 약해져 하락

[미국]
2y 0.79% (+3.0bp) / 전일 +2.8bp
10y 1.62 (+2.8bp) / 전일 +3.5bp
30y 2.34% (+2.4bp) / 전일 +3.9bp

[기타 10Y물]
영국 0.73% (-1.4bp) / 전일 +2.4bp
독일 -0.10% (+2.8bp) / 전일 -0.3bp
프랑스 0.22% (+4.1bp) / 전일 -0.1bp
이탈리아 1.26% (+7.9bp) / 전일 -2.3bp
스페인 0.93% (+5.6bp) / 전일 -3.6bp
그리스 8.10% (+0.1bp) / 전일 +0.0bp

2.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> 美 제조업 지표 호조에 따른 금리인상 우려 부각에 하락 마감
도이체방크에 대한 우려와 브렉시트가 급속히 진행될 수 있다는 두려움도 증시 하락에 한 몫

* 9월 美 제조업 활동은 신규수주와 생산지수 호조에 힘입어 확장세로 전환
ISM 제조업 PMI 49.4-> 51.5... 조사치 49.7 상회

* 도이체방크, 美 당국과 벌금 협상 계속... 의미있는 합의안이 나오지 않은 만큼 협상 과정을 더

지켜볼 필요가 있다. <WSJ>

* 메이 영국 총리, 내년 3월 말 전에 EU 탈퇴 공식 협상을 시작하겠다고 밝혀
  EU 탈퇴 관련 규정을 담고 있는 리스본 조약 50조를 내년 1분기까지 발동할 예정

- 금요일 .. 도이체방크와 미 법무부가 애초 부과받은 벌금 $140억을 $54억으로 낮추는 합의에 근접한 것으로 알려져 금융주 강세 보이며 상승

* <유럽 마감> 에너지 업종의 강세에 힘입어 상승
  파운드화가 3개월 만에 최저치로 떨어지면서 수출 증가에 대한 기대감도 지수 상승에 보탬

- 금요일 .. 도이체방크, 미 법무부 합의 소식에 반등에 성공하였으나 원자재 업종 비중이 큰 영국 증시는 국제 유가 부진 영향으로 하락

* <상하이 마감> 국경절로 휴장

- 금요일 .. 국경절 앞두고 제조업 지표 호조 & IMF 특별인출권 편입 등의 호재로 상승

* <도쿄 마감> 도이체방크 벌금 경감 소식으로 위험자산 회피 심리가 누그러지면서 상승

- 금요일 .. 도이체방크 사태로 인한 금융주 타격으로 투자심리가 나빠지면서 하락 마감

DOW30	18253.85	(-0.30%) / 전일	+0.91%
NASDAQ	5300.87	(-0.21%) / 전일	+0.81%
S&P500	2161.20	(-0.33%) / 전일	+0.80%
NIKKEI225	16598.67	(+0.90%) / 전일	-1.46%
SHANGHAI	3004.70	(휴장) / 전일	+0.21%
FTSE100	6983.52	(+1.22%) / 전일	-0.29%
DAX30	10511.02	(휴장) / 전일	+1.01%
CAC40	4453.56	(+0.12%) / 전일	+0.10%

3.글로벌 환시

* 달러화, 연준의 기준금리 인상 기대가 제조업 지표 호조로 커져 상승
英 파운드화, 급격한 브렉시트 우려로 한때 1.2818달러로 하락하며 31년래 최저치 수준까지 근접

- 금요일 .. 엇갈린 경제지표와 도이체방크발 불안 완화로 엔화에는 오르고 유로화에는 내리는 혼조새

유로/달러 1.1211 (-0.0029) / 전일 +0.0019
유로/엔 113.94 (+0.04) / 전일 +0.57
달러/엔 101.63 (+0.33) / 전일 +0.28
달러/위안 국경절 휴장 / 전일 6.6778 (+0.0078)
파운드/달러 1.28339 (-0.01401) / 전일 +0.00096
NDF 1103.00 / 1104.00원…1.95원 상승 / 전일 1101.50 / 1102.50원…0.45원 상승

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 하산 로우하니 이란 대통령 발언 영향으로 상승
이란 대통령, 베네수엘라 대통령과의 전화 통화에서 국제 유가 안정을 위해 OPEC 산유국들의 협조가 필수적이라고 강조

- 금요일 .. OPEC 회원국들의 감산 합의 효과가 이어져 상승 마감

* <국제 금값> 미국 제조업 활동이 확장세로 돌아선 데다 달러화가 강세를 나타내 하락

- 금요일 .. 미국 경제지표가 혼조세를 보인 가운데 도이체방크발 금융시장 혼란 우려가 완화되면서 소폭 하락

WTI 48.81 (+1.2%) / 전일 +0.90%
COMEX금 1312.70 (-0.3%) / 전일 -0.7%

5. 전일 국내 지표 (마지막 영업일 기준)

코스피 2043.63 (-1.21%)
코스닥 681.21 (-1.25%)
원/달러 1101.30 (+2.50)
KTB 110.97 (+0.08)

LKTB 133.21 (+0.32)

6. 전일 국내 주요 금리 (마지막 영업일 기준)

* 국고채 금리, 하락 마감. 장내 국고채 5년물 16-4호 스퀴즈가 발생하면서 한때 국고 3년물과 5년물 금리가 역전. 외인이 3년과 10년 국채선물을 순매한 점도 강세 분위기에 영향을 미침

1y 1.3050% (-2.20bp)
3y 1.2470% (-5.00bp)
5y 1.2540% (-6.60bp)
10y 1.3980% (-5.80bp)
20y 1.4330% (-6.10bp)
30y 1.4410% (-5.80bp)
CD 1.3400% (0.00bp)

7. 본드 스왑 스프레드 (마지막 영업일 기준)

1Y -4.30bp (+1.80bp)
2Y -5.75bp (+2.80bp)
3Y -2.20bp (+3.50bp)
5Y -2.90bp (+4.35bp)
10Y -13.05bp (+3.55bp)

8. IRS/CRS 동향 (마지막 영업일 기준)

* IRS, 외인의 국채선물 매수에 따른 강세로 하락 마감.
* CRS 금리도 하락. 국채선물 급등이 CRS시장에도 다소 영향을 미친 듯함.

*IRS 금리

1Y 1.2700% (-0.50bp)

2Y 1.2325% (-1.50bp)
3Y 1.2250% (-1.50bp)
5Y 1.2250% (-2.25bp)
7Y 1.2350% (-2.25bp)
10Y 1.2675% (-2.25bp)

1*2Y -3.75 (-1.00bp)
2*3Y -0.75 (+0.00bp)
2*5Y -0.75 (-0.75bp)
3*5Y 0.00 (-0.75bp)
5*7Y 1.00 (0.00bp)
5*10Y 4.25 (0.00bp)

*CRS 금리

1Y 1.1650% (-1.50bp)
2Y 1.0150% (-1.50bp)
3Y 0.9700% (-2.50bp)
5Y 0.8900% (-4.00bp)
7Y 0.8300% (-4.00bp)
10Y 0.8000% (-4.00bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* AFP 통신, 익명의 소식통을 인용해 도이체방크와 미 법무부가 도이체방크에 부과한 벌금 140억 달러를 54억달러로 낮추는데 거의 합의했다고 보도

* 클리블랜드 연은 총재 '그동안 일자리 창출 촉진과 물가 상승을 이끈 것을 고려하면 기준금리를 약간 올리는 것이 적절'

* 8월 美 건설지출, 두 달 연속 하락하며 8개월래 최저 수준
전월 대비 0.7% 감소한 $1조1420억달러...전문가 예상치 0.3% 증가를 크게 밑도는 수준이며 지난해 12월 이후 최저치

* 도이체 CEO, '최근 언론보도가 부당한 우려를 야기...은행의 기본 체력이 강한 상황이다'

* 엇갈린 美 8월 경제지표
  - 개인소비지출(PCE) 전월치와 동일... 지난 3월 이후 가장 약한것이며 조사치 0.2% 하회
  - PCE 가격지수, 전월 대비 0.1%, 전년 대비 1.0% 각각 상승
  - 근원 PCE 가격지수 전년대비 1.7% 상승하며 연준 목표치인 2%에 한발 더 다가섬... 기준금리 인상 명분 마련된 셈

* 美 9월 소비자심리 지수 4개월만에 처음으로 상승세 전환... 상대적으로 낮은 가솔린과 식료품 가격, 꾸준한 임금 인상이 소비에 대한 미국인들의 긍정 심리 자극
  - 전달 89.8 에서 1.4포인트 오른 91.2 기록

[국내]

* 기재부, 내달 11일 국고채 50년물 1.1조 발행
- 낙찰금리는 1.535%, 국고채 10년물 (1.495%) 대비 +4bp
- 최종인수단
  은행(1) : 국민은행
  증권사(9) : 대신증권, 동부증권, 미래에셋증권, 미래에셋대우증권, 메리츠증권, 삼성증권, 신한금융투자, NH투자증권, 현대증권

* <KTB콘퍼런스>
- 유일호 "韓 국채 글로벌 안전자산 위상 공고"
- 이기홍 KIC 전무 "통화정책만으로는 경기자극 한계"
- 기재부 국고국장 "50년물 발행...초장기물 벤치마크 기대"
- 기재부 "11월부터 국고채 정상적 발행"
- 안태일 국민연금 채권운용실장 "국내 채권 투자 지속 확대"
- 뱅가드 "저금리 일시적 상황 아니다...기대수익률 낮춰야"
- "아시아 투자매력 높은 지역"

주간 예정 지표

10월 4일

중국 국경절 휴일 (10/1~7일)

[제프리 래커 리치먼드 연은 총재 연설]
[ECB 비통화정책회의]

영국-9월 건설 PMI (예상:49.0, 이전:49.2)
유로존-8월 PPI(MoM) (예상:-0.1%, 이전:0.1%)
한국-8월 경상수지 (이전:8.32B)
호주-기준금리 결정

10월 5일

[찰스 에번스 시카고 연은 총재 연설]

한국-9월 CPI(YoY) (예상:0.8%, 이전:0.4%) / CPI(MoM) (예상:0.2%, 이전:-0.1%)
미국-ADP 9월 신규고용 (예상:170K, 이전:177K)
-8월 무역수지 (예상:-40.00B, 이전:-39.50B)
-9월 서비스 PMI (예상:51.9, 이전:51.9)
-9월 복합 PMI (이전:52.0)
-8월 공장주문(MoM) (예상:-0.2%, 이전:1.9%)
-ISM 9월 비제조업 PMI (예상:53.0, 이전:51.4)
-원유재고 (이전:-1.882M)
호주-8월 소매판매(MoM) (예상:0.2%, 이전:0.0%)
독일-9월 서비스 PMI (예상:50.6, 이전:50.6)
유로존-9월 서비스 PMI (예상:52.1, 이전:52.1)
-9월 복합 PMI (예상:52.6, 이전:52.6)
-8월 소매판매 (예상:-0.3%, 이전:1.1%)
영국-9월 서비스 PMI (예상:52.0, 이전:52.9)

10월 6일

[ECB 9월 통화정책회의 의사록]

미국-실업보험청구자수 (예상:255K, 이전:254K)
독일-8월 공장주문(MoM) (예상:0.2%, 이전:0.2%)
유로존-소매 PMI (이전:51.0)
한국-9월 외환보유고(USD) (이전:375.46B)

10월 7일

[스탠리 피셔 연준 부의장 연설]
[라엘 브레이너드 연준 이사 연설]
[로레타 메스터 클리블랜드 연은 & 에스더 조지 캔자스시티 연은 총재 연설]

미국-9월 실업률 (예상:4.9%, 이전:4.9%)
-9월 비농업고용 (예상:170K, 이전:151K)
-9월 평균임금(MoM) (예상:0.3%, 이전:0.1%)
-8월 도매재고(MoM) (예상:-0.1%, 이전:+0.0%%)
독일-8월 산업생산(MoM) (예상:0.8%, 이전:-1.5%)
영국-8월 산업생산(MoM) (예상:0.1%, 이전:0.1%)
-8월 제조업생산(MoM) (예상:0.5%, 이전:-0.9%)