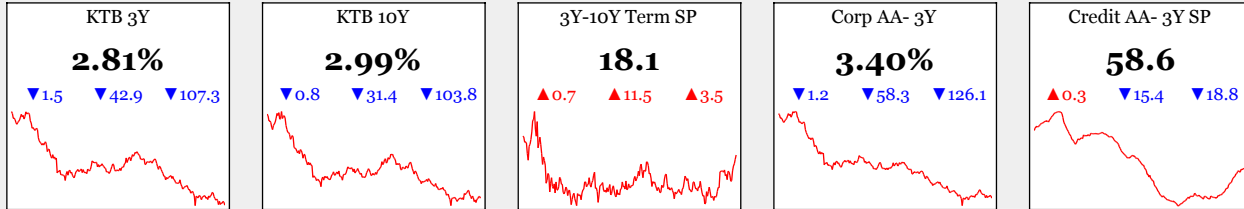


AICraft Korea Bond Market Daily

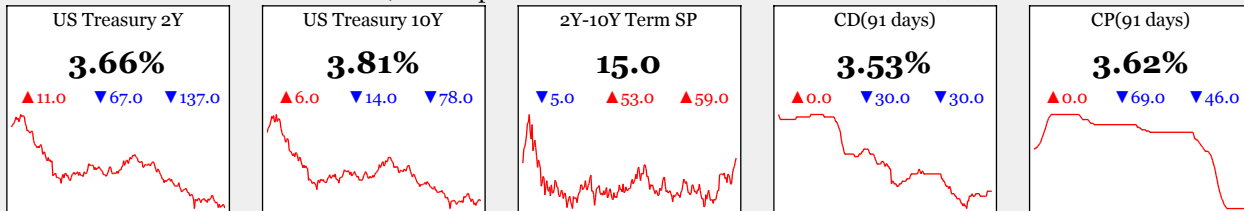
October 2, 2024

[주요지표]

국채수익률 (DoD / YTD / YoY, 단위: bp)



미국국채수익률 (DoD / YTD / YoY, 단위: bp)



(Source - 한국은행 경제통계 시스템 (<https://ecos.bok.or.kr>) 및 세인트루이스 연준 | Federal Reserve Economic Data (FRED) (<https://fred.stlouisfed.org>))

[시장 동향]

9월 ISM 제조업지수는 47.2pt로 예상치(47.5pt)를 하회했고 8월 JOLTS 구인건수는 804만건으로 예상치(769만건)를 상회했습니다. 예상을 하회한 ISM 제조업지수와 지정학적 리스크에 따른 안전자산 선호심리에 미 국채금리 하락했습니다.

[주요 경제 뉴스 및 이벤트]

미국 주요 News

8월 구인건수는 804만 건으로 예상치(764만 건)와 전월치(804만 건)를 일제히 상회했습니다. 지난 7월 구인 건수는 2021년 1월 이후 3년 만에 가장 적었으나 8월 들어 미국 고용시장이 소폭 개선되었습니다.

9월 ISM 제조업 PMI는 47.2(예상치 47.6, 전월치 47.2)로 발표되었습니다. 신규 수주 지수와 생산 지수가 지수 상승 견인했습니다. ISM은 수요는 계속 약해지고 있고 생산은 감소하는 한편 투자는 여전히 꺼리는 상태라고 발표했습니다.

한국 주요 News

8월 JOLTS 구인건수는 804만건으로 예상치(764만건)와 전월치(804만건)를 일제히 상회했습니다. 지난 7월 구인 건수는 2021년 1월 이후 3년 만에 가장 적었으나 8월 들어 미국 고용시장이 소폭 개선되었습니다. 구인율은 4.6%에서 4.8%로 전월 대비 상승했고 퇴직률(3.4%→3.1%), 구직률(3.4%→3.3%), 이직률(2.0%→1.9%)은 전월 대비 하락했습니다.

9월 미국 ISM 제조업 PMI는 47.2(예상치 47.6, 전월치 47.2)로 발표되었습니다. 신규 수주 지수와 생산 지수가 지수 상승을 견인했습니다. ISM은 수요는 계속 약해지고 있고 생산은 감소하는 한편 투자는 여전히 꺼리는 상태라고 발표했습니다.

기타 News 및 Event

9월 유로존 소비자 물가상승률은 1.8%YoY로 3년 만에 2%를 하회했습니다. ECB의 금리 인하 기대감과 함께 유로존 채권 금리는 장기물 위주의 강세를 보였고 미 국채 금리에 강세 압력을 주었습니다.

이란은 5개월 여만에 이스라엘에 약 180발의 탄도미사일을 발사했습니다. 군사 충돌과 확전에 대한 공포심은 투매 심리를 자극했습니다. 특히 엔비디아(-3.7%), 애플(-2.9%), 마이크로소프트(-2.2%), 테슬라(-1.4%) 등 대형 기술주 주가와 나스닥 지수가 큰 폭으로 하락했습니다.

[대응 전략]

분기말이 지난 이후에도 이런 현상이 지속되는지 꾸준히 모니터링 필요하며, 2019년의 레포 발작 때와는 아직 규모 자체가 비교할 만한 수준도 되지 않습니다.

본 보고서는 개인 블로그인 <https://aicraft.life> 에서 제공하고 있습니다.

Disclaimer - 본 보고서에 포함된 정보는 신뢰할 수 있는 자료로부터 얻어진 것이지만 그 정확성이나 완전성을 보장하지 않습니다. 이 보고서는 정보 제공을 목적으로 하며, 특정 증권이나 금융상품의 매수 또는 매도를 권유하거나 제안하는 것이 아닙니다. 보고서에 표현된 의견은 사전 통지 없이 변경될 수 있습니다. 투자 결정은 전적으로 투자자의 책임이며, 필요에 따라 전문적인 조언을 구하시기 바랍니다.