

GLOBAL

- Pada tanggal 16 September 2022, pasar finansial masih memberikan signal relative risk off akibat kekhawatiran pelaku pasar atas tingginya inflasi, kenaikan suku bunga yang agresif dan potensi terjadinya resesi ekonomi pasca peringatan dari Bank Dunia dan IMF akan terjadinya resesi global.
- Universitas Michigan merilis hasil surveynya yang lebih rendah dari ekspektasi khususnya mengenai ekspektasi inflasi AS ke depan sehingga meredam perkiraan yang lebih agresif dari kenaikan suku bunga The Fed. Hasil survey U. of Mich. Sentiment 59.5 lebih rendah dari ekspektasi 60.0, 1Y Inflation 4.6%, dan 5-10Y Inflation 2.8% lebih rendah dari ekspektasi 2.9%.
- Penjualan ritel Tiongkok naik 5.4% YoY pada Agustus 2022 dari 2.7% YoY pada Juli, dan lebih tinggi dari ekspektasi sebesar 3.5% YoY akibat pelonggaran pembatasan Covid-19. Pertumbuhan penjualan didorong oleh mobil, produk minyak, pakaian, perlengkapan kantor, dan peralatan rumah tangga.
- Dari pasar saham AS, semua indeks utama ditutup turun akibat sentiment pasar di atas. Sentimen risk-off di pasar saham juga dipicu oleh FedEx Corp yang menurunkan perkiraan pendapatannya akibat menurunnya permintaan global. Penurunan pada bursa AS dipimpin oleh penurunan harga saham di sektor energi dan industri.
- Dari pasar valas, rilis data survey Universitas Michigan di atas menahan USD menguat lebih lanjut. EUR menguat tipis seiring pelaku pasar menghentikan aksi jual EUR terhadap USD dan didukung penguatan EUR terhadap GBP. GBP melemah setelah data penjualan ritel Inggris bulan Agustus dirilis turun lebih rendah dari ekspektasi sehingga meningkatkan kekhawatiran pelaku pasar bahwa ekonomi Inggris sedang meluncur ke dalam resesi karena krisis biaya hidup menekan pengeluaran rumah tangga. Retail Sales Inc Auto Fuel MoM -1.6% (ekspektasi -0.5%) dan Retail Sales Exc Auto Fuel MoM -1.6% (ekspektasi -0.7%). JPY menguat seiring pelaku pasar masih mengantisipasi intervensi pihak otoritas terhadap pelemahan JPY. CNH melemah setelah rilis data penjualan ritel China di atas dan produksi industry juga meningkat 4.8% lebih tinggi dari ekspektasi 3.8%.
- Dari pasar obligasi AS, mayoritas yield UST mengalami kenaikan seiring ekspektasi kenaikan suku bunga The Fed lebih lanjut namun terbatas oleh rilis data hasil survey University Michigan di atas.
- Pada pasar komoditas, harga minyak naik karena tumpahan di terminal Basra Irak diperkirakan akan mengurangi pasokan minyak mentah. Harga emas juga naik karena menurunnya tekanan dari kenaikan suku bunga The Fed setelah rilis data hasil survey University Michigan di atas.

DOMESTIK

- Dari pasar Indonesia, sentiment risk off di atas menekan IDR melemah dan IHSG ditutup turun walaupun investor asing mencatatkan pembelian bersih. Penurunan IHSG dipimpin oleh saham sektor Energy.
- Dari pasar obligasi Indonesia, yield SBN mayoritas ditutup naik mengikuti kenaikan yield UST. Terpantau per tanggal 15 September 2022 (settlement date), kepemilikan asing mengalami kenaikan sebesar 2.61 Triliun Rupiah dari hari sebelumnya, hingga saat ini berjumlah Rp 750.20 T, atau sekitar 14.93% dari total kepemilikan SBN.
- Survei pemantauan harga BI pada minggu ke-3 September 2022 memperkirakan inflasi September 2022 sebesar 1.09% mtm. Kenaikan perkiraan inflasi didorong oleh komponen harga bensin (0.91% mtm) dan tarif angkutan dalam kota (0.04% mtm). Harga bahan pangan seperti beras dan telur ayam terpantau naik 0.02% mtm, sedangkan harga rempah seperti bawang merah turun 0.05% mtm.

Currencies	Last Close	1D	5D	YTD
DXY	109,74	0,02%	0,70%	14,73%
EUR/USD	1,0001	0,15%	-0,26%	-11,91%
GBP/USD	1,1467	-0,41%	-1,46%	-15,61%
AUD/USD	0,6702	0,21%	-1,83%	-7,53%
NZD/USD	0,5966	0,39%	-1,96%	-12,26%
USD/JPY	143,52	-0,42%	0,32%	24,19%
USD/CNH	7,0131	-0,19%	0,89%	10,11%
USD/SGD	1,4091	-0,15%	0,54%	4,30%
USD/IDR	14898	0,38%	0,84%	4,85%

Govt. Bond Yield	Last Yield (%)	1D(bps)	5D(bps)	YTD(bps)
US Treasury 5Y	3,67	-3,36	19,74	236,98
US Treasury 10Y	3,45	0,15	13,98	194,05
US Treasury 30Y	3,47	4,78	6,62	161,12
Indo (IDR) 5Y	6,50	8,87	13,31	158,07
Indo (IDR) 10Y	7,11	3,24	4,68	83,22
Indo (IDR) 20Y	7,13	2,51	-0,27	11,06
Indo (USD) 5Y	4,45	1,05	17,17	239,75
Indo (USD) 10Y	4,65	-1,28	12,72	248,60
Indo (USD) 30Y	5,28	-0,45	10,36	195,94
Indo CDS (USD) 5Y	105,36	5,42	-0,30	35,48

Commodities	Last Price	1D	5D	YTD
Nymex WTI Crude	85,10	0,01%	-1,94%	13,16%
ICE Brent Crude	90,84	0,56%	-1,60%	17,45%
Gold	1665,11	0,60%	-2,43%	-8,43%
Natural Gas	8,32	-6,73%	-2,90%	108,15%
Coal	438,00	-2,28%	-0,60%	254,60%
Nickel	23096,25	4,90%	5,53%	16,04%
Copper	7848,75	0,26%	-0,69%	-19,21%
CPO	831,38	-0,44%	3,15%	-33,27%

Equity Indices	Last Close	1D	5D	YTD
Dow Jones	30961,82	-0,45%	-4,13%	-15,18%
S&P 500	3901,35	-0,72%	-4,77%	-18,73%
Nasdaq	11552,36	-0,90%	-5,48%	-26,82%
Eurostoxx 50	3541,79	-1,17%	-1,95%	-18,57%
FTSE100	7282,07	-0,62%	-1,56%	-2,00%
Australia ASX 200	6828,62	-1,52%	-2,25%	-9,48%
Nikkei 225	27818,62	-1,11%	-2,29%	-4,25%
Hang Seng	18930,38	-0,89%	-3,10%	-19,81%
Shanghai	3199,92	-2,30%	-4,16%	-14,10%
Indonesia (JCI)	7305,60	-1,87%	-1,02%	8,92%
Indonesia (LQ45)	1041,04	-2,40%	-1,55%	9,08%
IDX SMC Comp	386,12	-0,79%	-0,06%	9,58%

Foreign Flow	Date	1D	WTD	YTD
Equity	16-Sep-22	1939	358	73118
Bonds	15-Sep-22	2610	3120	-121360

Equity Indices	Last Close	1D (%)	5D (%)
Keuangan	1541,72	-1,88%	-0,06%
Energi	2079,26	-2,14%	1,20%
Pertambangan & Material	1303,30	0,06%	-2,44%
Aneka industri	1385,43	-1,59%	-0,14%
Konsumen dasar	706,15	-0,51%	0,80%
Konsumen siklikal	882,15	-0,24%	-0,24%
Kesehatan	1454,78	-0,38%	0,81%
Properti & Real Estate	745,54	-1,13%	2,95%
Teknologi	7519,08	-0,47%	-2,01%
Infrastruktur	1030,79	-0,34%	-0,71%
Transportasi & Logistik	1917,18	-0,71%	0,01%

Indicator	Last Close	1D (bps)	5D (bps)
JIBOR IDR (1M)	4,26	1,75	13,59
SOFR USD (1M)	3,0184	0,0965	0,21
TED	28,75	14,94	14,85
FRA-OIS (3M)	2,10	2340,00	2000,00
VIX	26,27	3,00	351,00