

Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향 (단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB009	111.79	▼16	-0.38
10KTB009	132.20	▼55	-1.70
국고3Y	0.940	▲4.7	0.12
국고10Y	1.516	▲3.0	0.14
국고10Y-3Y	57.600	▲1.7	-1.70
KOSPI	2,326.17	▼27.63	▼3.66
USD/KRW	1,187.85	▲3.45	▼1.30

◇ 전일 해외시장 동향 (단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1309	▲0.39	▼2.04
미국5년	0.2673	▼0.16	▼1.46
미국10년	0.7048	▼1.63	▲5.06
미국30년	1.4747	▼2.63	▲11.88
독일10년	-0.397	▲1.20	▲9.40
호주10년	1.020	▲10.45	▲14.10
S&P500	3500.31	▼7.70	▲69.03
USD Index	92.172	▼0.20	▼1.13
WTI	42.61	▼0.36	▼0.74

차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락

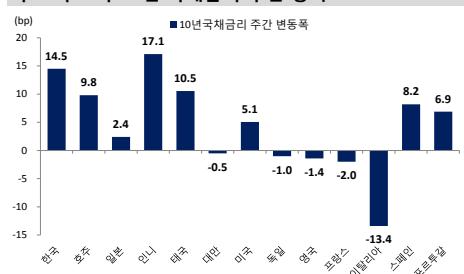
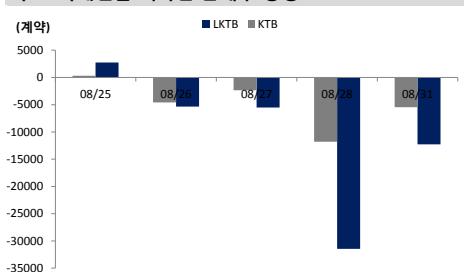


차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(08/31)	금 일(09/01)	의 일(09/02)
21:00 독일 8월 CPI YoY(결과: 0.1%, 이전: -0.1%)	08:00 한국 2분기 GDP QoQ(F)(예상: -3.3%, 잠정: -3.3%)	21:15 미국 8월 ADP 취업자 변동(예상: 950k, 이전: 167k)
22:00 미국 Fed 리처드 클라리다 부의장 연설	10:45 중국 8월 차이신 제조업 PMI(예상: 52.5, 이전: 52.8)	23:00 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권이) 연설
23:30 미국 8월 덜러스 연준 제조업 활동(결과: 8.0, 이전: -3.0)	13:30 호주 RBA 통화정책회의 기준금리 결정(예상: 기준금리 동결)	23:30 미국 DOE 주간 원유재고(예상: -, 이전: -4689k)
23:30 미국 Fed 라파엘 보스틱(애틀란타, 투표권이) 총재 연설	16:55 독일 8월 마켓 제조업 PMI(F)(예상: 53.0, 잠정: 53.0)	(09/03)
	18:00 유럽 8월 CPI YoY(예상: 0.2%, 이전: 0.4%)	02:00 독일 엔스 바이트만 분데스방크 총재 연설
	22:45 미국 8월 마켓 제조업 PMI(F)(예상: -, 잠정: 53.6)	03:00 미국 Fed 베이지북 공개
	23:00 미국 8월 ISM 제조업지수(예상: 54.4, 이전: 54.2)	04:00 미국 Fed 날 카시카리(미니애폴리스, 투표권이) 연설

*주 : 예상 대비 호조(상승), 예상치 부합, 예상 대비 부진(하락), Bloomberg 컨센서스 기준

KTB Futures

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	미결제약정
NKTB009	111.98	111.99	111.77	111.79	-0.16	1.001%	111.80	-0.01	2.82	161,217	417,352
NKTB012	111.78	111.78	111.78	111.78	-0.14	1.004%	111.60	0.18	2.82	-	-
10KTB009	132.81	132.86	132.20	132.20	-0.55	1.517%	132.26	-0.06	8.23	78,497	172,539
10KTB012	132.36	132.36	132.36	132.36	-0.69	1.503%	131.86	0.50	8.23	-	1

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	
NKTB003	112.02	112.10	112.17	112.11
10KTB003	133.16	133.57	133.97	133.83
KTB3Y	0.869	0.845	0.829	0.832
KTB5Y	1.146	1.116	1.092	1.101
KTB10Y	1.443	1.409	1.373	1.372

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

		NKTB003	10KTB003
	2차저항	112.07	133.08
	1차저항	111.93	132.64
PIVOT	PIVOT	111.85	132.42
	1차지지	111.71	131.98
	2차지지	111.63	131.76
Demark	High	111.89	132.53
	Low	111.67	131.87

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헛지비율

NKTB009	수익률	3선 헛지비율		10KTB009	수익률	3선 헛지비율		10KTB012	수익률	(단위 : %, 계약)	
		10선 헛지비율	3선 헛지비율			10선 헛지비율	3선 헛지비율			3선 헛지비율	10선 헛지비율
국고 19-7	0.906	71.5	국고 20-3	0.942	86.7	국고 19-4	1.499	265.1	국고 20-4	1.524	286.0
		20.8			25.2			77.2			83.5
국고 19-3	0.850	56.2	국고 19-7	0.906	71.5	국고 19-8	1.515	272.6	국고 19-8	1.515	272.6
		16.3			20.8			80.0			80.0
국고 20-1	1.218	140.1	국고 20-1	1.218	140.1						
		40.8			40.8						

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	0.630	0.000	0.000	0.000
통안1년	0.691	0.020	0.066	0.062
국고1년	0.722	0.021	0.052	0.050
국고3년	0.940	0.047	0.116	0.115
국고5년	1.210	0.035	0.117	0.110
국고10년	1.516	0.030	0.138	0.129
국고20년	1.666	0.024	0.097	0.087
국고30년	1.663	0.014	0.084	0.071
국고50년	1.665	0.017	0.086	0.073

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

	CRS	IRS	CRS-IRS
	중간값	전일비	Basis
1년	0.110	0.010	0.008
2년	0.025	0.010	0.018
3년	0.025	0.005	0.028
4년	0.025	0.005	0.035
5년	0.055	0.005	0.040
7년	0.190	0.005	0.038
10년	0.295	0.005	0.038

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-12,280	2,989	2,951	2,834	770
1주	-51,848	32,582	6,694	7,454	2,146
2주	-44,911	27,789	4,802	9,106	1,953
4주	-56,463	42,333	-1,814	5,557	1,907
누적	256,906	-207,510	-36,364	-25,550	-12,820

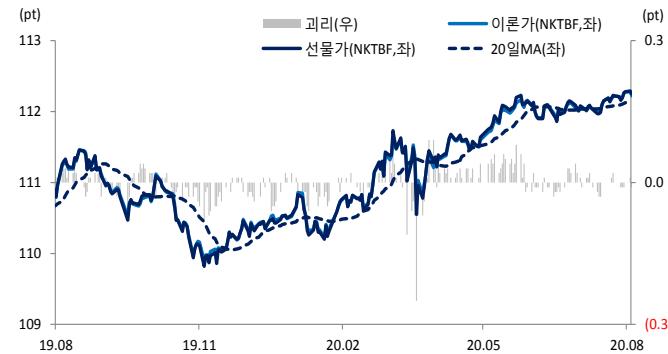
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-5,445	3,831	184	360	246
1주	-23,881	12,552	1,640	2,499	2,176
2주	-19,784	8,471	2,618	338	3,030
4주	-19,291	5,264	4,165	-2,678	4,750
누적	95,927	-79,235	-2,730	-9,012	-3,141

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



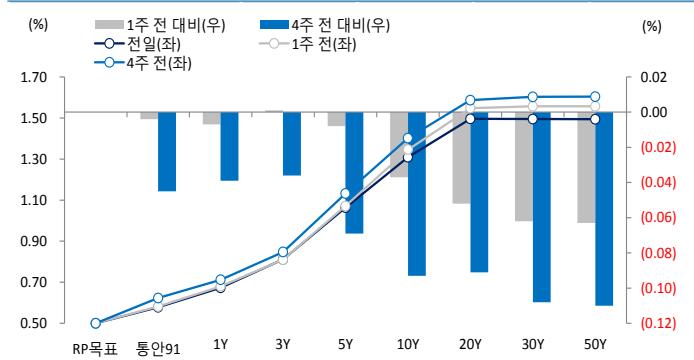
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



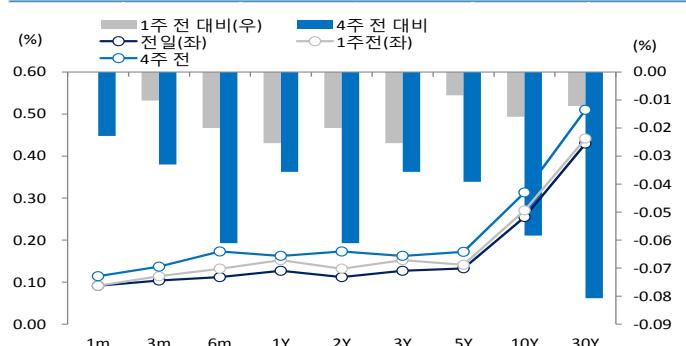
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



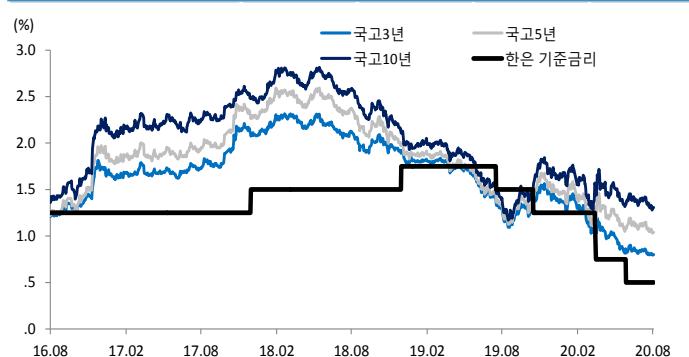
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



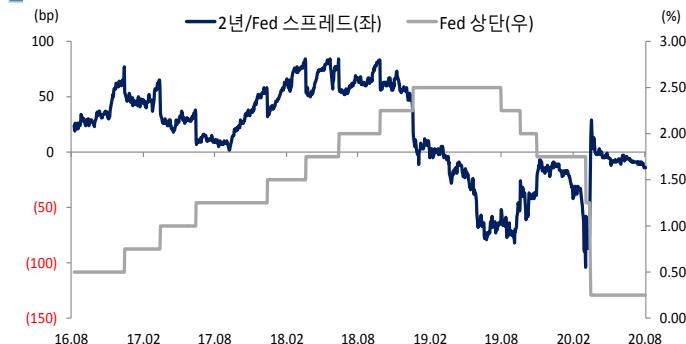
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



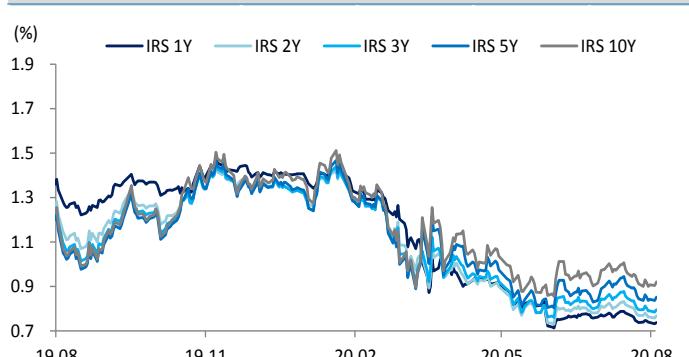
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터