

Fixed Income / 김태현

☎ 82-2-3774-0423

✉ kimth@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

(단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB003	111.51	▲9	▼9
10KTB003	133.78	▼8	▼45
국고3Y	1.062	▼2.4	▲1.1
국고10Y	1.387	▲1.8	▲5.0
국고10Y-3Y	32.5	▲4.2	▲3.9
KOSPI	1834.33	▼73.94	▼73.94
USD/KRW	1206.5	▲13.50	▲25.30

◇ 전일 해외시장 동향

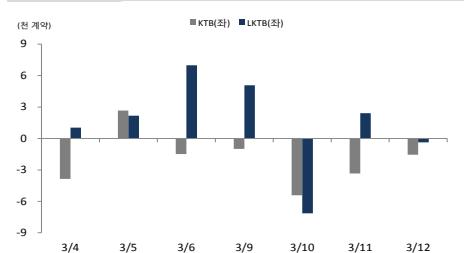
(단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국 2Y	0.4810	▼3.85	▼11.63
미국 5Y	0.6035	▼9.99	▼7.44
미국 10Y	0.8042	▼6.53	▼10.78
미국 30Y	1.4399	▲4.80	▼10.08
독일 10Y	-0.741	▲0.10	▼5.50
호주 10Y	0.768	▲8.90	▼1.20
S&P500	2741.38	▼140.85	▼388.74
USD Index	97.487	▲0.98	▲0.67
WTI	31.50	▼1.48	▼9.78

차트. 전일 미국&독일 10Y 국채 금리



차트. 외국인 국채선물 순매수 동향



출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(03/12)

19:00 유럽 1월 산업생산 MoM(결과: 2.3%, 이전:-2.1%)

21:30 미국 2월 PPI YoY(결과: 1.3%, 이전: 2.1%)

21:45 유럽 ECB 통화정책회의

(13일)

06:00 한국 2월 수출물가지수 YoY(결과: -1.8%, 이전: -2.7%)

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

금 일(03/13)

16:00 독일 2월 CPI YoY(F)(예상: 1.7%, 잠정: 1.7%)

21:30 미국 2월 수입물가지수 MoM(예상: -1.0%, 이전: 0.0%)

23:00 미국 3월 미시간대 소비자신뢰(P)(예상: 95.0, 이전: 101.0)

의 일(03/16)

08:50 일본 1월 핵심기계수주 MoM(예상: -0.8%, 이전: -12.5%)

11:00 중국 2월 광공업생산 YTD YoY(예상: -3.0%, 이전: 5.7%)

21:30 미국 3월 뉴욕 연은 제조업지수(예상: 5.1, 이전: 12.9)

KTB Futures

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	(단위 : pt, %, 계약) 미결제약정
NKTB003	111.35	111.51	111.31	111.51	0.09	1.090%	111.48	0.03	2.82	186,760	280,692
NKTB006	111.48	111.68	111.45	111.68	0.13	1.036%	111.58	0.10	2.82	19,834	101,941
10KTB003	133.38	133.96	133.21	133.78	-0.08	1.373%	133.73	0.05	8.25	120,108	115,570
10KTB006	133.42	134.00	133.29	133.40	-0.50	1.408%	133.72	-0.32	8.25	4,799	35,515

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	60MA
NKTB003	111.49	111.50	111.24	110.78
10KTB003	134.08	134.13	133.25	131.47
KTB3Y	1.069	1.077	1.151	1.287
KTB5Y	1.175	1.172	1.250	1.390
KTB10Y	1.353	1.348	1.426	1.570

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

		NKTB003	10KTB003
PIVOT	2차저항	111.64	134.40
	1차저항	111.58	134.09
	PIVOT	111.44	133.65
	1차지지	111.38	133.34
	2차지지	111.24	132.90
	Demark	High Low	134.25 133.50

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헛지비율

NKTB003	수익률	헷지비율	NKTB006	수익률	헷지비율	10KTB003	수익률	헷지비율	10KTB006	수익률	헷지비율
국고 18-9	1.058	55.47	국고 19-3	1.062	70.83	국고 18-10	1.375	77.77	국고 19-4	1.380	80.50
국고 19-3	1.062	70.96	국고 19-5	1.185	139.25	국고 19-4	1.380	80.23	국고 19-8	1.379	82.62
국고 19-5	1.185	139.51	국고 19-7	1.059	85.98						

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	1.390	-0.010	-0.010	-0.030
통안1년	1.051	-0.004	-0.026	-0.193
국고1년	1.022	-0.010	-0.024	-0.213
국고3년	1.062	-0.024	0.011	-0.213
국고5년	1.187	-0.007	0.044	-0.217
국고10년	1.387	0.018	0.050	-0.222
국고20년	1.438	0.025	0.026	-0.185
국고30년	1.448	0.027	0.023	-0.169
국고50년	1.448	0.028	0.023	-0.169

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

CRS		IRS		CRS-IRS	
	중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
1년	-0.040	-0.250	1.090	-0.023	-1.130
2년	0.025	-0.155	1.023	-0.015	-0.998
3년	0.050	-0.150	1.005	0.005	-0.955
4년	0.070	-0.140	1.005	0.013	-0.935
5년	0.085	-0.130	1.005	0.023	-0.920
7년	0.165	-0.145	0.995	0.023	-0.830
10년	0.240	-0.145	1.023	0.030	-0.783

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
3월 12일	-1,544	11,279	1,231	-7,973	-68
3월 11일	-3,331	11,251	1,301	-8,653	37
3월 10일	-5,419	342	2,341	1,695	364
3월 9일	-985	-6,768	3,711	-1,042	1,153
3월 6일	-1,475	7,738	1,437	5,579	608
1주	-12,754	23,842	10,021	-10,394	2,094
2주	-9,030	3,520	9,561	-7,247	522
4주	15,714	-12,747	1,609	-10,946	1,180
누적	242,822	-194,857	-22,995	-10,982	-3,639

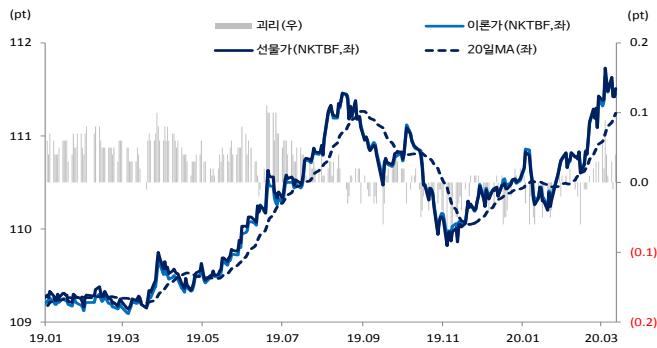
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
3월 12일	-366	-162	-78	-262	124
3월 11일	2,411	-1,129	-316	-1,871	616
3월 10일	-7,141	5,765	129	-1,264	909
3월 9일	5,082	-2,077	-67	-2,345	-18
3월 6일	6,988	777	956	-653	-98
1주	6,974	3,174	624	-6,395	1,533
2주	11,765	-6,261	-2,328	-4,137	1,042
4주	39,942	-29,230	-2,823	-2,334	-933
누적	71,202	-51,138	-672	-2,045	-6,746

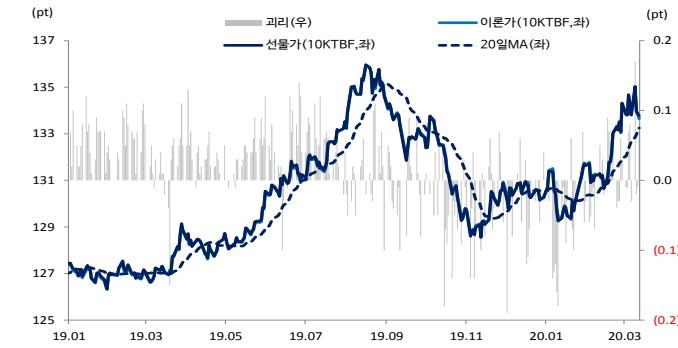
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



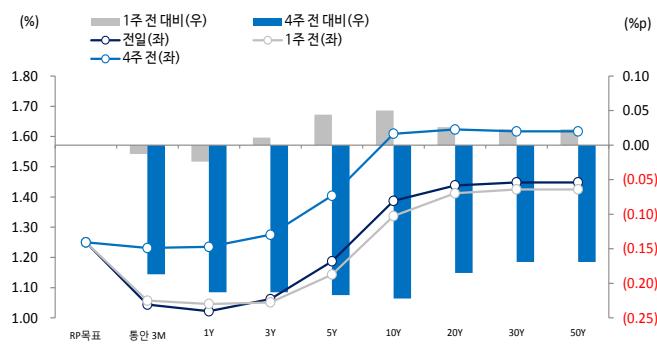
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



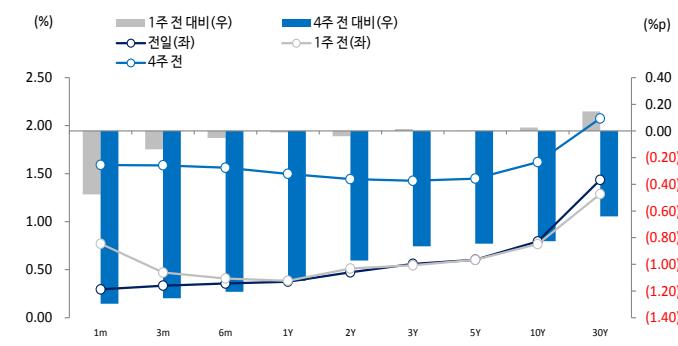
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



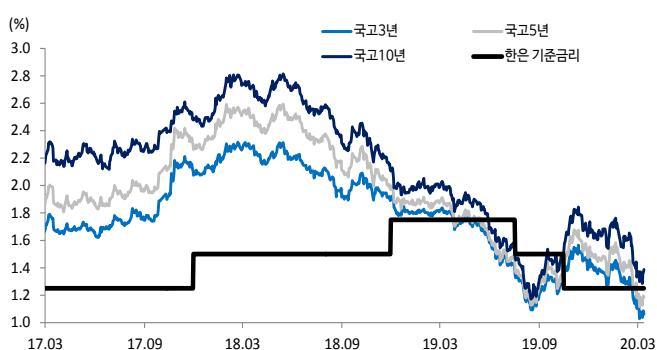
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



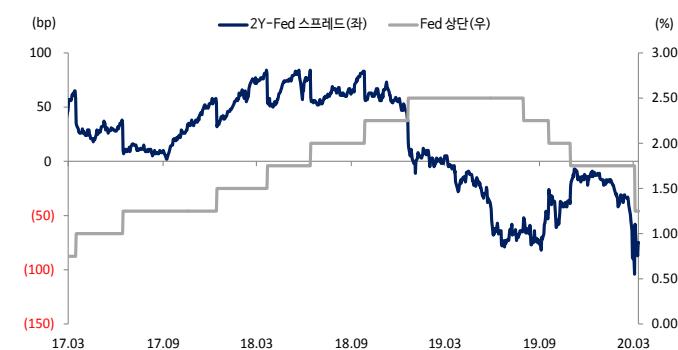
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



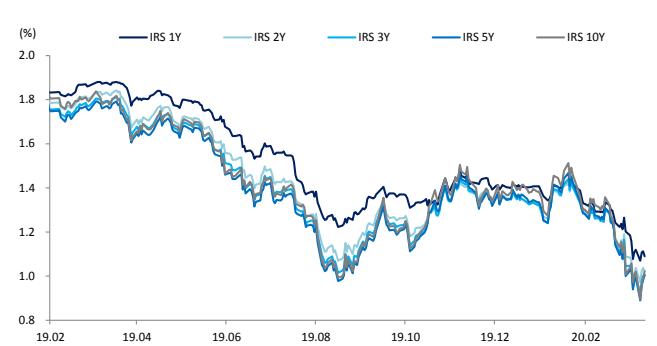
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



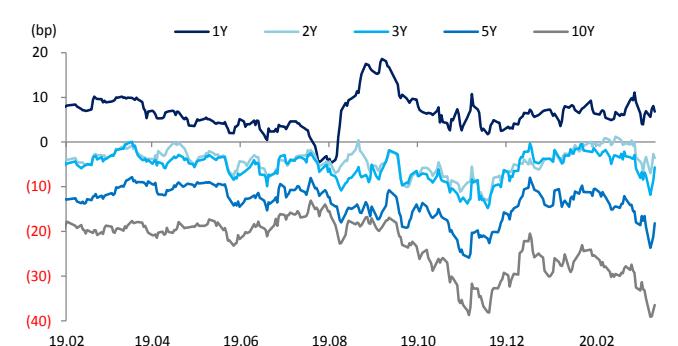
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터