

Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

(단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB003	112.07	▼13	-0.07
10KTB003	133.60	▼34	-0.09
국고3Y	0.854	▲4.1	0.03
국고10Y	1.410	▲3.1	0.01
국고10Y-3Y	55.600	▲1.0	-1.00
KOSPI	2,304.59	▲30.37	▼132.94
USD/KRW	1,186.30	▼0.70	▲3.00

◇ 전일 해외시장 동향

(단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1432	▲0.21	▼0.18
미국5년	0.2643	▼0.80	▼3.02
미국10년	0.6282	▼2.27	▼8.12
미국30년	1.3407	▼4.26	▼10.64
독일10년	-0.507	▼1.10	▼8.60
호주10년	0.854	▼1.10	▼3.40
S&P500	3397.16	▲11.65	▲24.31
USD Index	93.247	▲0.45	▲0.15
WTI	42.34	▼0.24	▼0.55

차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락

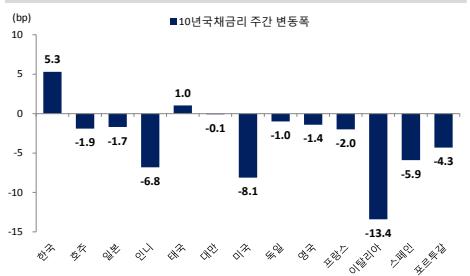
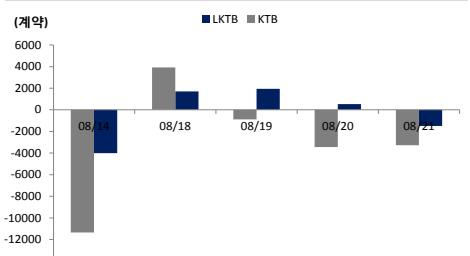


차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(08/21)

- 16:30 독일 8월 마켓 제조업 PMI(P)
결과: 53.0, 이전: 51.0
17:00 유럽 8월 마켓 제조업 PMI(P)
결과: 51.7, 이전: 51.8
22:45 미국 8월 마켓 제조업 PMI(P)
결과: 53.6, 이전: 50.9
23:00 유럽 8월 소비자기대지수(**결과: -14.7**, 이전: -15.0)

금 일(08/24)

- 21:30 미국 7월 시카고 연준 국가활동지수(예상: 3.88, 이전: 4.11)
(08/25)
06:00 한국 8월 소비자심리지수(예상: --, 이전: 84.2)

의 일(08/25)

- 15:00 독일 2분기 GDP QoQ(F)
예상: -10.1%, 이전: -10.1%
17:00 독일 8월 IFO 기업환경지수(예상: 92.4, 이전: 90.5)
23:00 미국 8월 CB 소비자기대지수(예상: 93, 이전: 92.6)
23:00 미국 7월 신규주택매매(예상: 775k, 이전: 776k)
23:00 미국 8월 리치몬드 연은 제조업지수(예상: 10, 이전: 10)
(8/26)
06:00 한국 9월 기업경기실사 제조업(예상: --, 이전: 57)

KTB Futures

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	(단위 : pt, %, 계약) 미결제약정
NKTB009	112.21	112.22	112.05	112.07	-0.13	0.912%	112.07	0.00	2.82	121,006	425,460
NKTB012	112.05	112.05	112.05	112.05	-0.04	0.919%	111.89	0.16	2.82	-	-
10KTB009	133.94	134.03	133.53	133.60	-0.34	1.390%	133.54	0.06	8.25	78,114	185,717
10KTB012	133.55	133.55	133.55	133.55	-0.35	1.394%	133.14	0.41	8.25	-	1

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : pt, %)				
이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	60MA
NKTB003	112.18	112.19	112.22	112.11
10KTB003	133.94	134.08	134.40	133.84
KTB3Y	0.822	0.821	0.812	0.832
KTB5Y	1.087	1.083	1.066	1.101
KTB10Y	1.378	1.365	1.334	1.369

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

NKTB003		10KTB003
	2차저항	112.28
	1차저항	112.18
PIVOT	PIVOT	112.11
	1차지지	112.01
	2차지지	111.94
Demark	High	112.15
	Low	111.98

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헛지비율

NKTB009	수익률	3선 헛지비율		NKTB012	수익률	3선 헛지비율		10KTB009	수익률	3선 헛지비율	
		10선 헛지비율	10선 헛지비율			10선 헛지비율	10선 헛지비율			10선 헛지비율	10선 헛지비율
국고 19-7	0.822	72.2	국고 20-3	0.854	87.4	25.1	국고 19-4	1.380	267.8	국고 20-4	1.410
		20.7			25.1				76.4		288.9
국고 19-3	0.762	56.8	국고 19-7	0.822	72.2	20.7	국고 19-8	1.396	275.4	국고 19-8	1.396
		16.3			72.2				79.2		275.4
국고 20-1	1.129	140.9	국고 20-1	1.129	141.0	40.5	141.0	1.396	79.2		288.9
		40.5			40.5				141.0		82.6

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)				
	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	0.630	0.000	-0.020	-0.020
통안1년	0.635	0.017	0.017	0.017
국고1년	0.683	0.016	0.010	0.010
국고3년	0.854	0.041	0.026	0.026
국고5년	1.126	0.046	0.030	0.030
국고10년	1.410	0.031	0.014	0.014
국고20년	1.582	0.022	0.009	0.009
국고30년	1.593	0.018	0.019	0.019
국고50년	1.593	0.018	0.019	0.019

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

		CRS	IRS		CRS-IRS	
		중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
	1년	0.030	0.005	0.698	0.018	-0.668
	2년	-0.070	0.010	0.760	0.028	-0.830
	3년	-0.060	0.015	0.818	0.035	-0.878
	4년	-0.060	0.020	0.868	0.035	-0.928
	5년	-0.045	0.020	0.900	0.038	-0.945
	7년	0.075	0.020	0.935	0.033	-0.860
	10년	0.180	0.020	0.995	0.033	-0.815

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)					
일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-759	9,942	-2,414	-4,624	-930
1주	-5,470	13,309	-2,802	-7,379	241
2주	-9,958	20,832	-5,327	-7,495	-81
4주	5,376	16,089	-6,425	-13,563	-2,918
누적	305,833	-231,100	-39,602	-40,061	-14,331

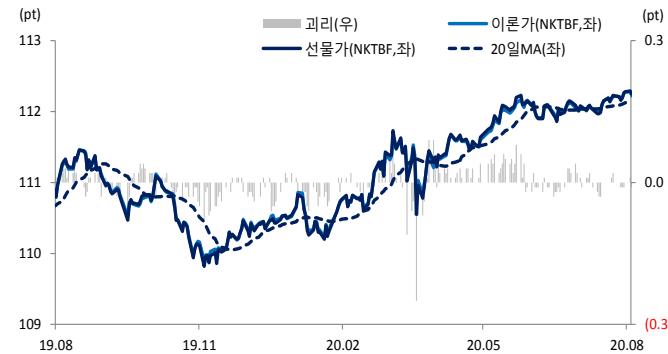
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-455	-452	601	-110	148
1주	-504	-3,077	1,728	-459	732
2주	12,811	-13,400	-657	-321	212
4주	28,427	-20,198	-3,469	-2,757	-1,294
누적	127,057	-96,124	-6,924	-8,669	-6,956

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



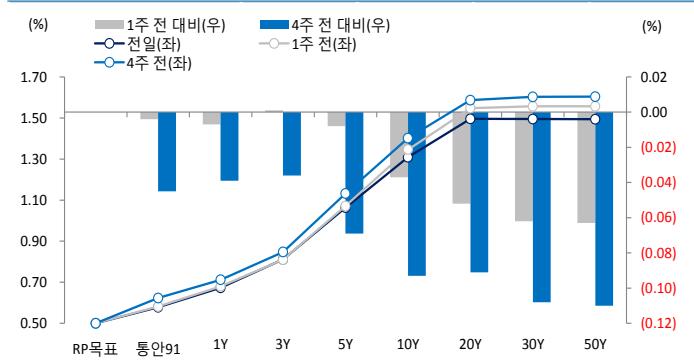
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



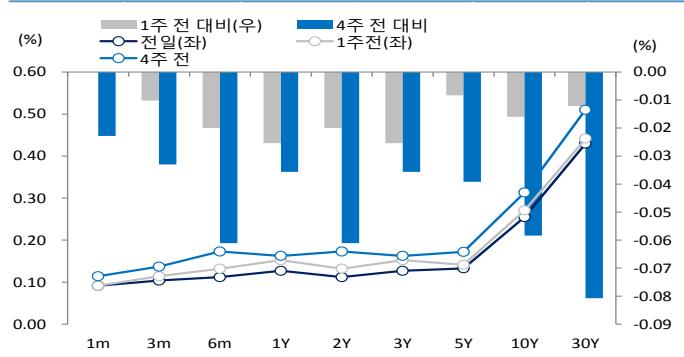
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



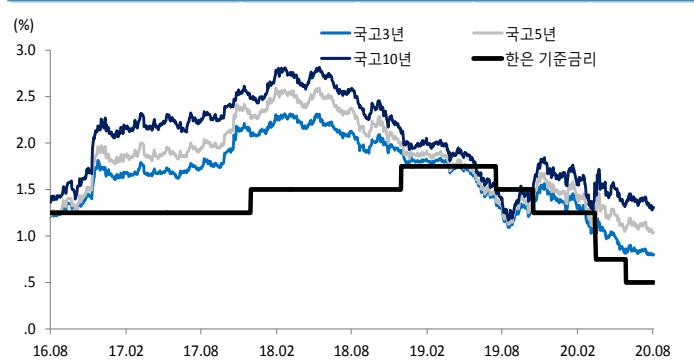
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



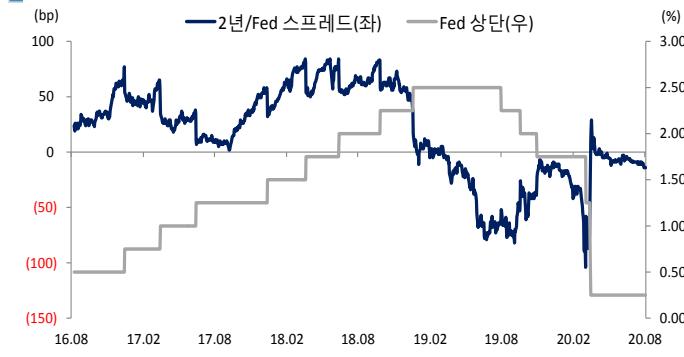
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



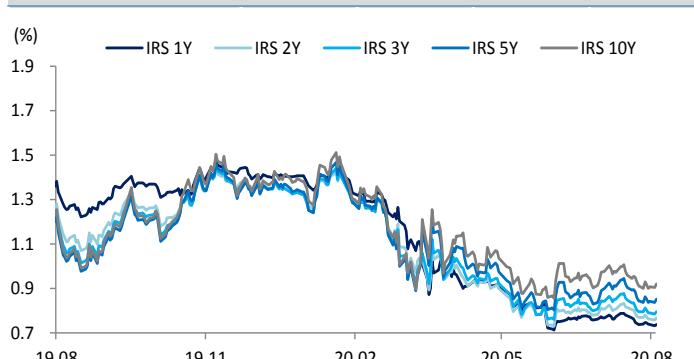
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

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