

## Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

## ◇ 전일 국내시장 동향

(단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

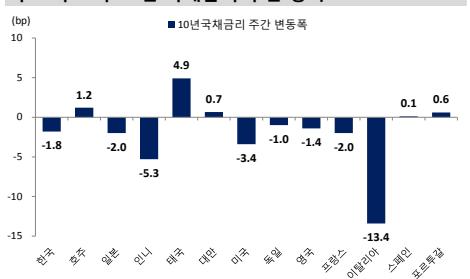
종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB009	112.17	▲10	-0.07
10KTB009	133.90	▲30	-0.32
국고3Y	0.824	▼3.0	0.01
국고10Y	1.378	▼3.2	0.02
국고10Y-3Y	55.400	▲0.2	-0.20
KOSPI	2,329.83	▲25.24	▼77.66
USD/KRW	1,189.15	▲2.85	▲4.55

## ◇ 전일 해외시장 동향

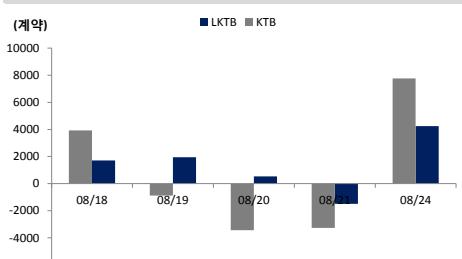
(단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1513	▲0.81	▲0.02
미국5년	0.2819	▲1.76	▼0.63
미국10년	0.6542	▲2.60	▼3.40
미국30년	1.3559	▲1.52	▼7.82
독일10년	-0.491	▲1.60	▼4.00
호주10년	0.879	▲2.47	▼5.45
S&P500	3431.28	▲34.12	▲49.29
USD Index	93.294	▲0.05	▲0.44
WTI	42.39	▲0.05	▼0.50

## 차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락



## 차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 경제지표 및 이벤트

## 전 일(08/24)

21:30 미국 7월 시카고 연준 국가활동지수(결과: 1.18, 이전: 5.33)

(08/25)

06:00 한국 8월 소비자심리지수(결과: 88.2, 이전: 84.2)

## 금 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 신규주택 매매(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)

## 의 일(08/26)

15:45 프랑스 8월 소비자기대지수(예상: 94, 이전: 94)

20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수 WoW(예상: --, 이전: -3.3%)

21:30 미국 7월 내구재주문 MoM(P)(예상: 4.5%, 이전: 7.6%)

23:30 미국 DOE 주간원유재고(예상: --, 이전: -1632k)

## KTB Futures

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	(단위 : pt, %, 계약) 미결제약정
<b>NKTB009</b>	112.06	112.20	112.05	112.17	0.10	0.881%	112.15	0.02	2.82	88,732	431,375
<b>NKTB012</b>	111.91	111.91	111.91	111.91	-0.14	0.963%	112.00	-0.09	2.82	-	-
<b>10KTB009</b>	133.50	134.02	133.50	133.90	0.30	1.362%	133.86	0.04	8.25	51,542	187,930
<b>10KTB012</b>	133.19	133.19	133.19	133.19	-0.36	1.427%	133.49	-0.30	8.24	-	1

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 이동평균

(단위 : pt, %)				
이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	
<b>NKTB003</b>	112.18	112.19	112.22	112.11
<b>10KTB003</b>	133.98	134.02	134.36	133.84
<b>KTB3Y</b>	0.821	0.822	0.813	0.832
<b>KTB5Y</b>	1.086	1.086	1.068	1.101
<b>KTB10Y</b>	1.374	1.371	1.338	1.369

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 기술적 지표

<b>NKTB003</b>		<b>10KTB003</b>	
	2차저항	112.29	134.33
	1차저항	112.23	134.11
<b>PIVOT</b>	PIVOT	112.14	133.81
	1차지지	112.08	133.59
	2차지지	111.99	133.29
<b>Demark</b>	High	112.26	134.22
	Low	112.11	133.70

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Basket 수익률과 헛지비율

<b>NKTB009</b>	수익률	3선 헛지비율 10선 헛지비율		<b>NKTB012</b>	수익률	3선 헛지비율 10선 헛지비율		<b>10KTB009</b>	수익률	3선 헛지비율 10선 헛지비율		<b>10KTB012</b>	수익률	3선 헛지비율 10선 헛지비율	
		72.1	20.6			87.5	25.0			266.5	76.2			287.4	82.4
<b>국고 19-7</b>	0.795	56.7	16.2	<b>국고 20-3</b>	0.825	72.3	20.6	<b>국고 19-8</b>	1.367	274.1	79.0	<b>국고 19-8</b>	1.367	274.1	79.0
<b>국고 20-1</b>	1.094	140.9	40.3	<b>국고 20-1</b>	1.094	141.3	40.3								

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 현물 금리 추이

(단위 : %, %p)			
	금리	전일비	1주대비
			4주대비
<b>CD91일</b>	0.630	0.000	-0.010
<b>통안1년</b>	0.625	-0.010	0.014
<b>국고1년</b>	0.670	-0.013	0.006
<b>국고3년</b>	0.824	-0.030	0.014
<b>국고5년</b>	1.093	-0.033	0.023
<b>국고10년</b>	1.378	-0.032	0.021
<b>국고20년</b>	1.569	-0.013	0.022
<b>국고30년</b>	1.579	-0.014	0.031
<b>국고50년</b>	1.579	-0.014	0.031

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS/IRS

		CRS	IRS		CRS-IRS	
		중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
	<b>1년</b>	0.035	0.005	0.688	-0.010	-0.653
	<b>2년</b>	-0.065	0.005	0.740	-0.020	-0.805
	<b>3년</b>	-0.055	0.005	0.790	-0.028	-0.845
	<b>4년</b>	-0.055	0.005	0.838	-0.030	-0.893
	<b>5년</b>	-0.035	0.010	0.868	-0.033	-0.903
	<b>7년</b>	0.090	0.015	0.905	-0.030	-0.815
	<b>10년</b>	0.195	0.015	0.965	-0.030	-0.770

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)					
일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
<b>당일</b>	4,241	4,285	-3,211	-2,440	-32
<b>1주</b>	6,937	-4,793	-1,892	1,652	-193
<b>2주</b>	3,782	-265	-6,186	-1,027	-847
<b>4주</b>	-5,138	5,447	-5,249	185	-1,862
<b>누적</b>	308,754	-240,092	-43,058	-33,004	-14,966

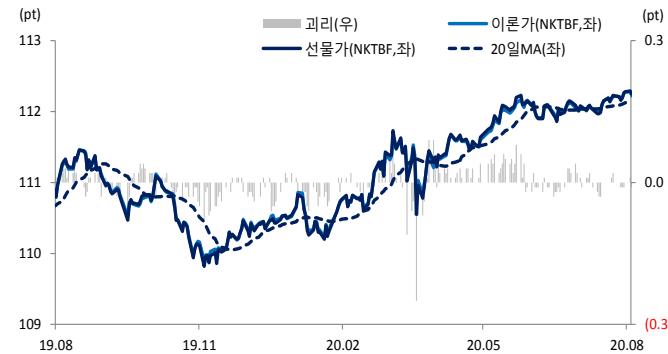
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
<b>당일</b>	7,763	-5,083	-622	-1,326	-64
<b>1주</b>	4,097	-4,081	978	-2,161	854
<b>2주</b>	-9,751	2,966	4,212	-3,112	2,384
<b>4주</b>	5,725	-5,700	1,412	-5,896	1,679
<b>누적</b>	119,808	-91,787	-4,370	-11,511	-5,317

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. NKTB 선물가 및 이론가



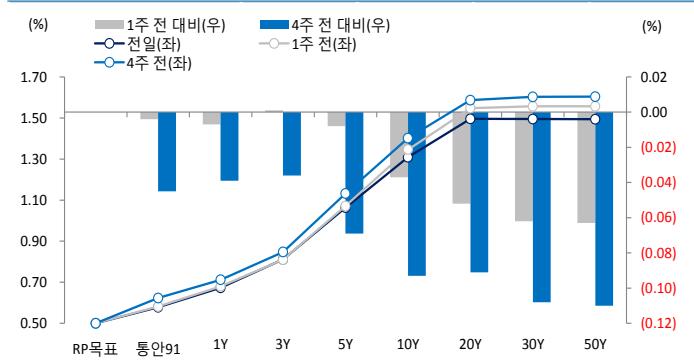
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. 10KTB 선물가 및 이론가



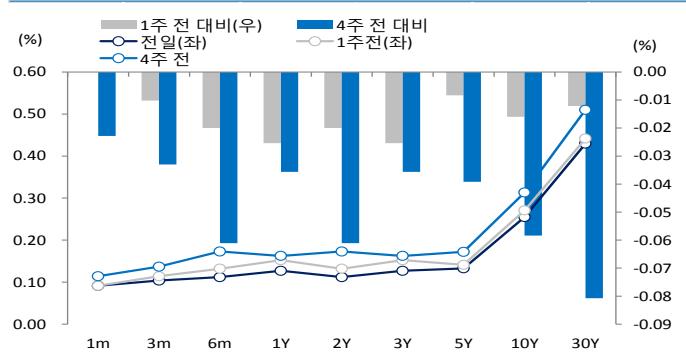
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. 한국 국채 수익률 곡선



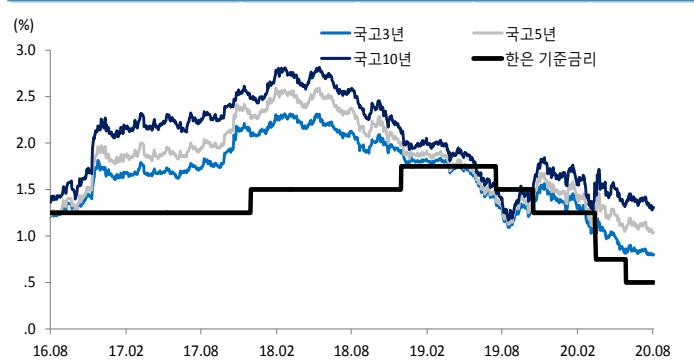
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. 미국 국채 수익률 곡선



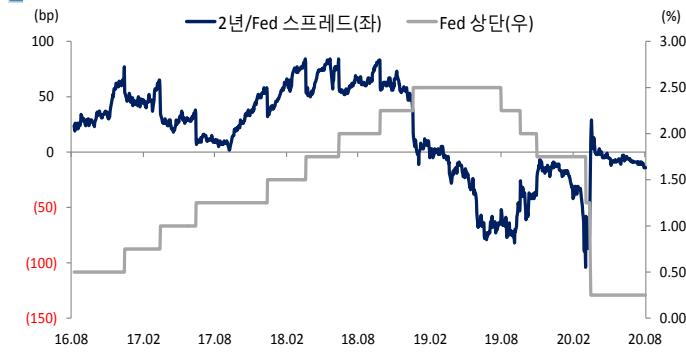
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



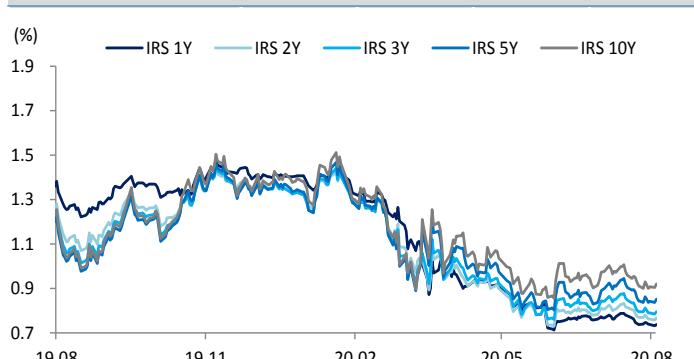
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



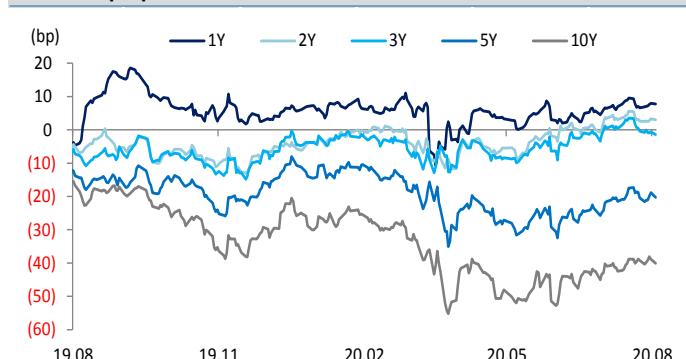
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터