

Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

(단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB009	112.13	▼4	-0.11
10KTB009	133.63	▼20	-0.62
국고3Y	0.835	▲1.0	0.03
국고10Y	1.404	▲1.7	0.06
국고10Y-3Y	56.900	▼0.7	0.70
KOSPI	2,369.32	▲2.59	▲8.78
USD/KRW	1,186.85	▲1.75	▲5.50

◇ 전일 해외시장 동향

(단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1504	▲0.11	▲1.13
미국5년	0.2852	▼0.79	▲0.18
미국10년	0.6884	▲0.49	▲0.83
미국30년	1.4135	▲2.00	▼1.03
독일10년	-0.415	▲1.60	▲5.70
호주10년	0.886	▲3.00	▲1.62
S&P500	3478.73	▲35.11	▲103.88
USD Index	92.893	▼0.13	▲0.01
WTI	43.41	▲0.06	▲0.83

차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락

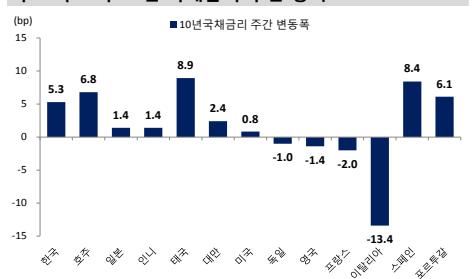
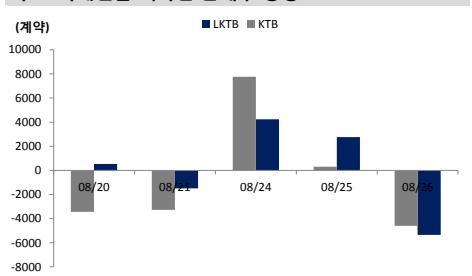


차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(08/26)

- 20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수 WoW(결과:-6.5%, 이전:-3.3%)
 21:30 미국 7월 내구재주문 MoM(P)(결과:11.2%, 이전:7.7%)
 23:30 미국 DOE 주간원유재고(결과: -4689k, 이전:-1632k)

금 일(08/27)

- 10:30 중국 7월 산업생산 YoY(예상:--, 이전:11.5%)
 21:30 미국 2분기 균원 PCE QoQ(예상:-1.1%, 이전:-1.1%)
 21:30 미국 2분기 GDP QoQ(예상:-32.5%, 이전:-32.9%)
 21:30 미국 주간 신규 실업수당청구(예상:1000k, 이전:1106k)
 21:30 미국 2분기 개인소비 QoQ(예상:-34.6%, 이전:-34.6%)
 22:10 미국 Fed 제롬 파월 의장 연설
 N/A 한국은행 8월 금통위 기준금리 결정(예상:기준금리 동결)

의 일(08/28)

- 15:00 독일 9월 GfK 소비자 기대지수(예상:1.0, 이전:-0.3)
 14:45 프랑스 2분기 GDP QoQ(F)(예상:-13.8%, 잠정:-13.8%)
 18:00 유럽 8월 소비자기대지수(F)(예상:--, 잠정:-14.7)
 21:30 미국 7월 개인소비지출 MoM(예상:1.5%, 이전:5.6%)
 21:30 미국 7월 도매재고 MoM(예상:-0.8%, 이전:-1.4%)
 21:30 미국 7월 개인소득 MoM(예상:-0.4%, 이전:-1.1%)
 23:00 미국 8월 미시간대학교 소비자신뢰(F)(예상:72.8, 잠정:72.8)

KTB Futures

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	미결제약정
NKTB009	112.16	112.17	112.08	112.13	-0.04	0.893%	112.11	0.02	2.82	83,636	432,867
NKTB012	112.02	112.02	112.02	112.02	0.02	0.928%	111.96	0.06	2.82	-	-
10KTB009	133.73	133.76	133.44	133.63	-0.20	1.387%	133.58	0.05	8.25	60,781	185,492
10KTB012	133.45	133.45	133.45	133.45	-0.06	1.403%	133.19	0.26	8.25	-	1

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	
	60MA			
NKTB003	112.15	112.18	112.21	112.11
10KTB003	133.78	133.92	134.27	133.85
KTB3Y	0.830	0.824	0.815	0.832
KTB5Y	1.103	1.090	1.073	1.101
KTB10Y	1.392	1.379	1.346	1.370

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

	NKTB003	10KTB003
2차저항	112.22	133.93
1차저항	112.17	133.78
PIVOT	PIVOT	133.61
1차지지	112.08	133.46
2차지지	112.04	133.29
Demark	High	133.70
Low	112.06	133.38

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	0.802	71.9	국고 20-3	0.835	87.2	국고 19-4	1.378	266.9	국고 20-4	1.405	288.1
		20.6			25.0			76.3			82.6
국고 19-3	0.758	56.5	국고 19-7	0.802	72.0	국고 19-8	1.394	274.6	국고 19-8	1.394	274.6
		16.2			20.6			79.1			79.1
국고 20-1	1.115	140.7	국고 20-1	1.115	140.9						
		40.4			40.4						

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)				
	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	0.630	0.000	0.000	0.000
통안1년	0.637	0.008	0.026	0.019
국고1년	0.677	0.005	0.015	0.010
국고3년	0.835	0.010	0.030	0.022
국고5년	1.114	0.014	0.053	0.034
국고10년	1.404	0.017	0.057	0.025
국고20년	1.590	0.011	0.049	0.030
국고30년	1.601	0.009	0.060	0.026
국고50년	1.600	0.008	0.058	0.025

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

		CRS	IRS		CRS-IRS	
		중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
	1년	0.095	0.035	0.700	0.010	-0.605
	2년	-0.015	0.035	0.758	0.013	-0.773
	3년	-0.015	0.030	0.810	0.015	-0.825
	4년	-0.015	0.030	0.865	0.018	-0.880
	5년	0.010	0.025	0.898	0.020	-0.888
	7년	0.145	0.025	0.938	0.023	-0.793
	10년	0.250	0.025	1.000	0.025	-0.750

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)					
일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-5,348	3,205	-173	3,424	134
1주	692	3,478	-2,162	2,682	-362
2주	1,472	1,473	-5,542	4,520	-2,366
4주	-11,372	15,336	-6,337	430	-1,828
누적	306,163	-238,555	-42,460	-30,345	-15,211

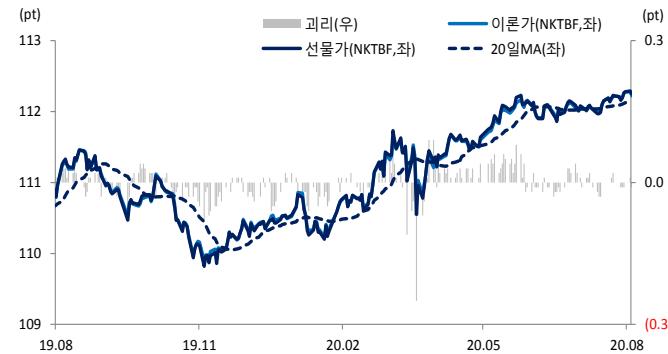
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-4,590	3,265	-178	-16	505
1주	-3,233	3,609	-551	-2,788	1,104
2주	-17,082	9,663	4,143	-3,665	3,247
4주	8,168	-9,214	799	-5,763	2,212
누적	115,522	-88,296	-4,637	-12,263	-4,649

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



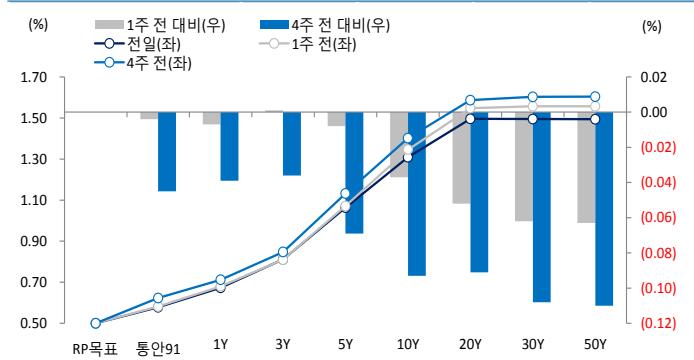
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



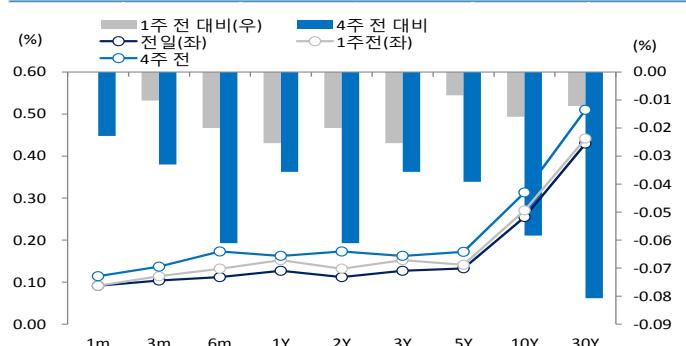
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



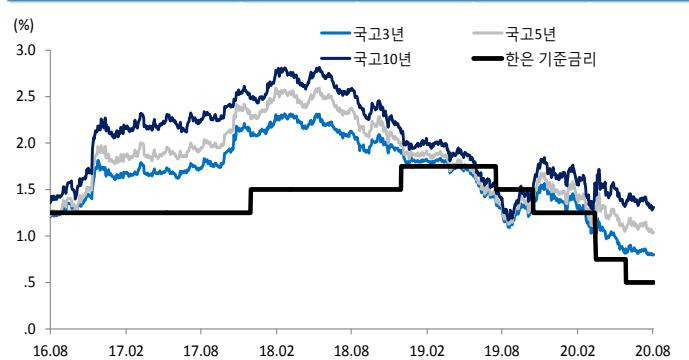
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



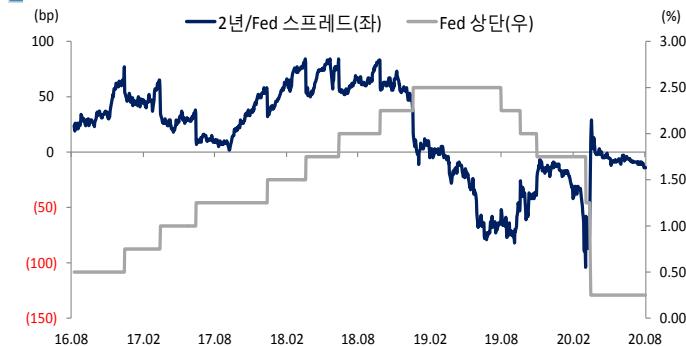
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



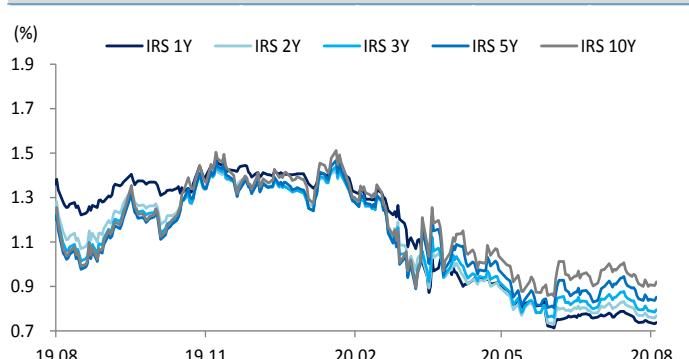
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



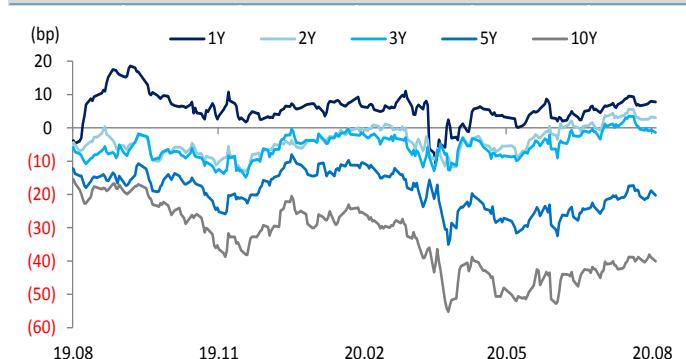
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터