

Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

(단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB009	111.82	▼3	-0.25
10KTB009	132.20	▲12	-1.20
국고3Y	0.919	▼0.4	0.07
국고10Y	1.524	▼1.5	0.10
국고10Y-3Y	60.500	▲1.1	-1.10
KOSPI	2,395.90	▲31.53	▲51.45
USD/KRW	1,188.25	▲2.70	▲3.25

◇ 전일 해외시장 동향

(단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1270	▼0.59	▼3.13
미국5년	0.2484	▼0.32	▼6.46
미국10년	0.6347	▼1.30	▼11.75
미국30년	1.3616	▼1.72	▼14.80
독일10년	-0.488	▼1.50	▼8.10
호주10년	0.933	▼3.75	▼1.75
S&P500	3455.06	▼125.78	▼29.49
USD Index	92.767	▼0.08	▼0.23
WTI	41.28	▼0.23	▼1.69

차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락

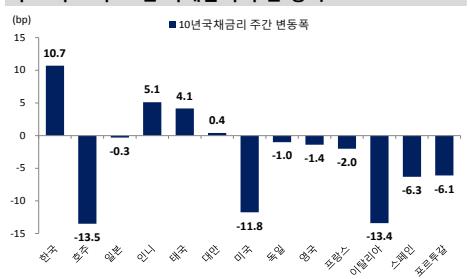
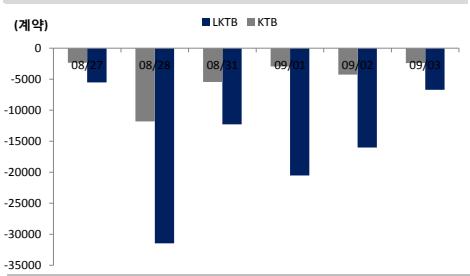


차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/03)

- 16:50 프랑스 8월 마킷 종합 PMI(F) **(결과: 51.6, 잠정: 51.7)**
 16:55 독일 8월 마킷 종합 PMI(F) **(결과: 54.4, 잠정: 53.7)**
 21:30 미국 주간 신규실업수당 청구 **(결과: 881k, 이전: 1011k)**
 22:45 미국 8월 마킷 종합 PMI(F) **(결과: 54.6, 잠정: 54.7)**
 23:00 미국 8월 ISM 비제조업지수 **(결과: 56.9, 이전: 58.1)**

금 일(09/04)

- 10:30 호주 7월 소매판매 MoM(예상: 3.3%, 이전: 2.7%)
 15:00 독일 7월 제조업수주 MoM(예상: 5.0%, 이전: 27.9%)
 17:30 영국 8월 마킷 건설 PMI(예상: 58.3, 이전: 58.1)
 21:30 미국 8월 비농업부문 고용자수 변동(예상: 1390k, 이전: 1763k)
 21:30 미국 8월 실업률(예상: 9.8%, 이전: 10.2%)

의 일(09/07)

- 15:00 독일 7월 산업생산 MoM(예상: -, 이전: 8.9%)
 17:30 유럽 9월 센티스 투자자기대지수(예상: -, 이전: -13.4)
 N/A 중국 8월 수출 YoY(예상: 6.0%, 이전: 7.2%)
 N/A 중국 8월 수입 YoY(예상: 1.0%, 이전: -1.4%)
 N/A 중국 8월 무역수지(예상: \$45.80b, 이전: \$62.33b)

KTB Futures

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	(단위 : pt, %, 계약) 미결제약정
NKTB009	111.81	111.90	111.76	111.82	-0.03	0.991%	111.84	-0.02	2.82	149,121	378,642
NKTB012	111.85	111.85	111.85	111.85	0.50	0.982%	111.65	0.20	2.82	10	8
10KTB009	131.97	132.40	131.85	132.20	0.12	1.517%	132.19	0.01	8.23	79,348	159,580
10KTB012	132.20	132.20	132.15	132.15	0.94	1.522%	131.80	0.35	8.23	2	4

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : pt, %)				
이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	
NKTB003	111.82	111.97	112.09	112.10
10KTB003	132.19	132.93	133.56	133.76
KTB3Y	0.930	0.884	0.850	0.836
KTB5Y	1.221	1.167	1.121	1.105
KTB10Y	1.529	1.465	1.410	1.378

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

NKTB003		10KTB003
	2차저항	111.97
	1차저항	111.89
PIVOT	PIVOT	111.83
	1차지지	111.75
	2차지지	111.69
Demark	High	111.93
	Low	111.79

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	0.883	71.3 20.7	국고 20-3	0.921	86.4 25.1	국고 19-4	1.506	263.5 77.1	국고 20-4	1.527	284.2 83.4
국고 19-3	0.836	55.9 16.2	국고 19-7	0.883	71.3 20.7	국고 19-8	1.522	270.9 80.0	국고 19-8	1.522	270.9 80.0
국고 20-1	1.223	139.7 40.7	국고 20-1	1.223	139.7 40.7						

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

	금리	전일비	1주대비	4주대비	(단위 : %, %p)
CD91일	0.630	0.000	0.000	0.000	
통안1년	0.697	0.001	0.055	0.026	
국고1년	0.721	0.001	0.039	0.020	
국고3년	0.919	-0.004	0.067	0.026	
국고5년	1.218	-0.010	0.086	0.043	
국고10년	1.524	-0.015	0.103	0.038	
국고20년	1.694	-0.006	0.099	0.052	
국고30년	1.683	-0.003	0.079	0.034	
국고50년	1.684	-0.004	0.080	0.036	

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

	CRS		IRS	(단위 : %, %p)	
	중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
1년	0.100	-0.015	0.723	0.003	-0.623
2년	0.015	-0.015	0.793	0.000	-0.778
3년	0.035	-0.015	0.865	-0.003	-0.830
4년	0.045	-0.005	0.935	-0.003	-0.890
5년	0.085	0.000	0.983	-0.003	-0.898
7년	0.220	0.000	1.025	-0.003	-0.805
10년	0.325	0.000	1.090	-0.003	-0.765

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험	(단위 : 계약)
당일	-6,708	3,993	-1,939	3,310	663	
1주	-86,958	64,928	5,040	7,718	3,938	
2주	-92,327	67,596	5,120	13,782	3,955	
4주	-108,714	82,786	1,695	10,915	3,655	
누적	213,681	-172,615	-35,348	-20,897	-11,083	

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험	(단위 : 계약)
당일	-2,398	3,050	1,008	-1,226	-43	
1주	-26,824	17,713	2,003	2,560	1,031	
2주	-28,965	19,083	2,237	414	2,220	
4주	-40,049	21,172	6,198	-545	4,703	
누적	86,350	-71,225	-1,717	-8,375	-3,373	

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



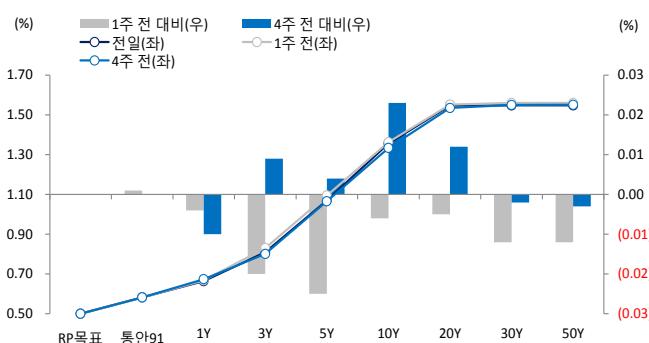
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



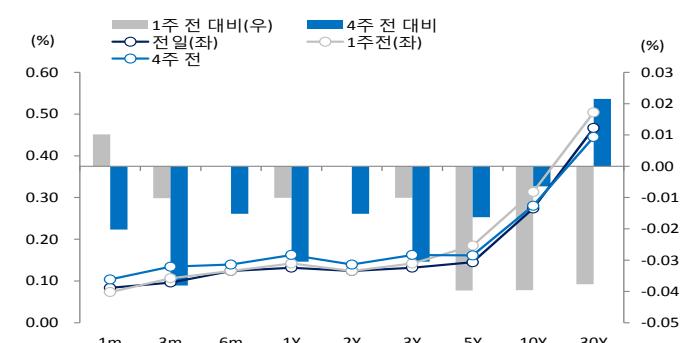
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



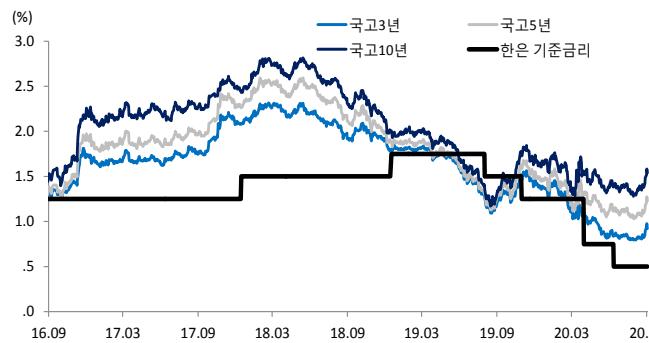
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



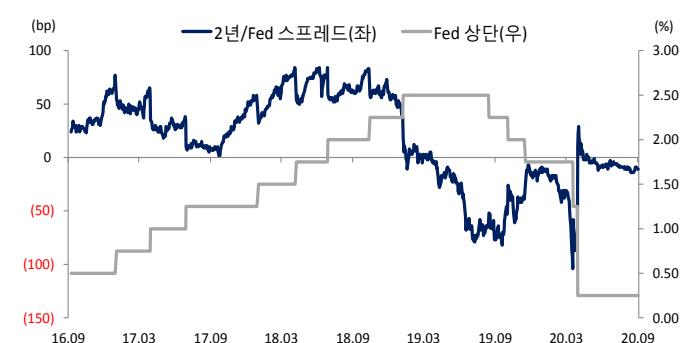
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



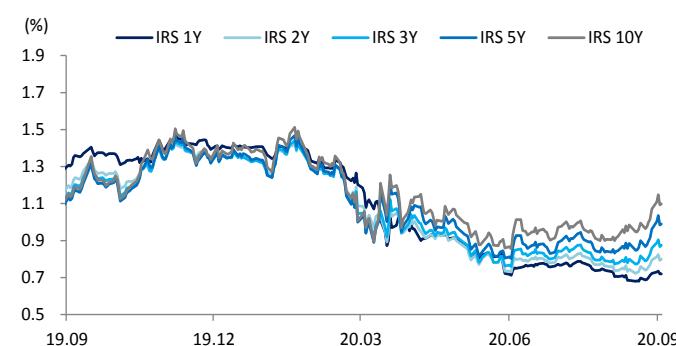
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



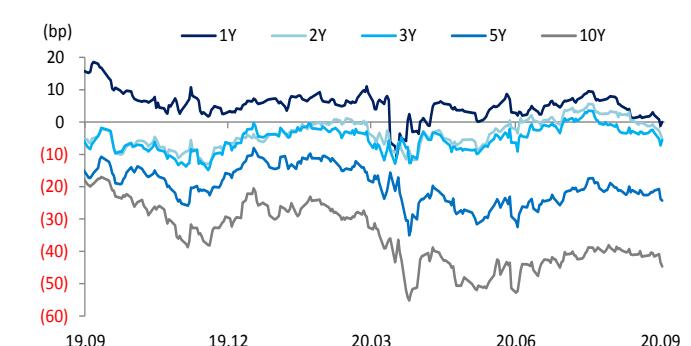
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터