

## Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

## ◇ 전일 국내시장 동향

(단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB009	111.78	▲12	0.07
10KTB009	131.93	▲28	0.23
국고3Y	0.949	▼2.4	-0.03
국고10Y	1.555	▼1.7	-0.03
국고10Y-3Y	60.600	▼0.7	0.70
KOSPI	2,401.91	▲17.69	▲52.36
USD/KRW	1,186.45	▼1.80	▲3.35

## ◇ 전일 해외시장 동향

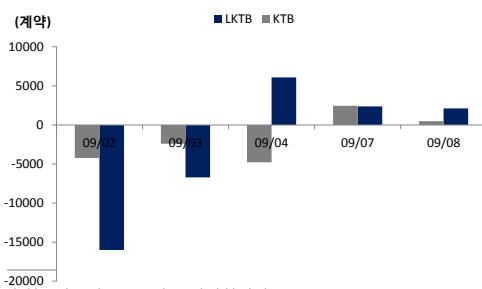
(단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1408	▼0.20	▲0.99
미국5년	0.2674	▼3.17	▲1.42
미국10년	0.6788	▼3.92	▲0.99
미국30년	1.4213	▼5.01	▲0.13
독일10년	-0.495	▼3.20	▼7.50
호주10년	0.968	▲7.75	▼1.45
S&P500	3331.84	▼95.12	▼168.47
USD Index	93.474	▲0.76	▲1.14
WTI	36.84	▼2.93	▼5.92

## 차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락



## 차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



## 주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/08)

금 일(09/09)

익 일(09/10)

18:00 유럽 2분기 GDP QoQ(F)(결과:-11.8%, 잠정:-12.1%)

19:00 미국 8월 NFIB 소기업 낙관지수(결과:100.2, 이전:98.8)

08:00 한국 8월 실업률(예상:4.3%, 이전:4.2%)

09:30 호주 9월 웨스트택 소비자기대지수(예상:--, 이전:79.5)

08:50 일본 7월 핵심기계수주 MoM(예상:2.0%, 이전:-7.6%)

20:45 유럽 ECB 통화정책회의 기준금리 결정(예상:동결)

10:30 중국 8월 PPI YoY(예상:-1.9%, 이전:-2.4%)

10:30 중국 8월 CPI YoY(예상:2.4%, 이전:2.7%)

15:00 일본 8월 공작기계수주 YoY(P)(예상:--, 이전:-31.1%)

20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수(예상:--, 이전:-2.0%)

21:30 유럽 ECB 라가르드 총재 연설

21:30 미국 8월 PPI YoY(예상:-0.3%, 이전:-0.4%)

21:30 미국 주간 신규실업수당 청구건수(예상:845k, 이전:881k)

23:00 미국 7월 도매재고 MoM(F)(예상:-0.1%, 잠정:-0.1%)

24:00 미국 DOE 주간 원유재고(예상:--, 이전:-9362k)

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

## KTB Futures

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	(단위 : pt, %, 계약) 미결제약정
NKTB009	111.71	111.83	111.68	111.78	0.12	1.004%	111.80	-0.02	2.82	106,337	380,599
NKTB012	111.68	111.70	111.58	111.67	0.09	1.039%	111.59	0.08	2.82	10	132
10KTB009	131.78	132.17	131.73	131.93	0.28	1.542%	131.92	0.01	8.23	59,173	157,974
10KTB012	131.42	131.61	131.42	131.54	-0.15	1.578%	131.54	0.00	8.23	8	255

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 이동평균

(단위 : pt, %)				
이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	
NKTB003	111.78	111.85	112.02	112.08
10KTB003	131.99	132.36	133.17	133.68
KTB3Y	0.939	0.919	0.870	0.841
KTB5Y	1.234	1.207	1.147	1.111
KTB10Y	1.543	1.513	1.443	1.386

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 기술적 지표

NKTB003		10KTB003
	2차저항	111.91
	1차저항	111.85
PIVOT	PIVOT	111.76
	1차지지	111.70
	2차지지	111.61
Demark	High	111.88
	Low	111.73

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Basket 수익률과 헛지비율

NKTB009	수익률	3선 헛지비율		10KTB009	수익률	3선 헛지비율		10KTB012	수익률	(단위 : %, 계약)	
		10선 헛지비율	NKTB012			10선 헛지비율	10선 헛지비율			3선 헛지비율	10선 헛지비율
국고 19-7	0.903	70.9	국고 20-3	0.948	86.1	국고 19-4	1.535	262.2	국고 20-4	1.552	282.8
		20.6			25.1			77.2			83.5
국고 19-3	0.854	55.5	국고 19-7	0.903	71.0	국고 19-8	1.546	269.6	국고 19-8	1.546	269.6
		16.1			20.6			80.0			80.0
국고 20-1	1.228	139.3	국고 20-1	1.228	139.5						
		40.7			40.7						

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 현물 금리 추이

(단위 : %, %p)			
	금리	전일비	1주대비
			4주대비
CD91일	0.630	0.000	0.000
통안1년	0.704	-0.014	-0.008
국고1년	0.733	-0.015	-0.013
국고3년	0.949	-0.024	-0.028
국고5년	1.234	-0.029	-0.039
국고10년	1.555	-0.017	-0.027
국고20년	1.675	-0.025	-0.054
국고30년	1.663	-0.028	-0.059
국고50년	1.664	-0.027	-0.060
			-0.024

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS/IRS

		CRS	IRS		CRS-IRS	
		중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
	1년	0.105	0.020	0.748	-0.018	-0.643
	2년	0.015	0.020	0.815	-0.020	-0.800
	3년	0.050	0.020	0.885	-0.018	-0.835
	4년	0.075	0.025	0.950	-0.023	-0.875
	5년	0.125	0.025	0.993	-0.028	-0.868
	7년	0.260	0.025	1.035	-0.028	-0.775
	10년	0.365	0.025	1.100	-0.028	-0.735

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)					
일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	2,106	-782	541	-1,545	-106
1주	-12,143	8,290	-585	2,725	525
2주	-87,268	51,971	6,968	18,186	3,926
4주	-83,305	52,444	1,361	18,487	1,626
누적	224,243	-189,789	-35,319	-15,583	-11,419

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	487	45	15	-471	-5
1주	-8,474	8,672	397	-861	86
2주	-35,599	21,582	2,869	3,339	2,046
4주	-46,385	26,394	7,186	-856	4,869
누적	84,513	-69,979	-1,590	-8,908	-3,108

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. NKTB 선물가 및 이론가



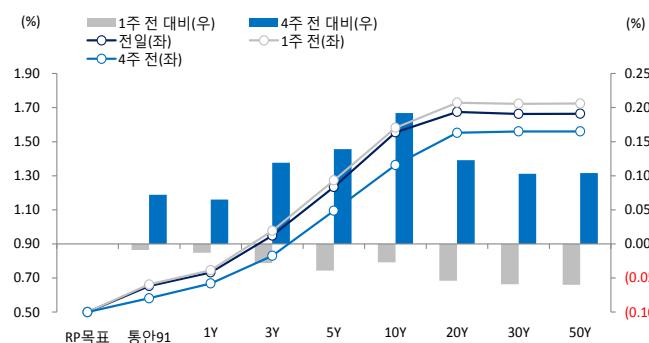
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. 10KTB 선물가 및 이론가



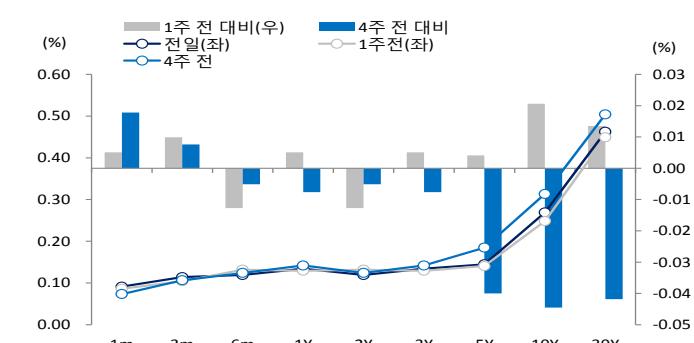
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. 한국 국채 수익률 곡선



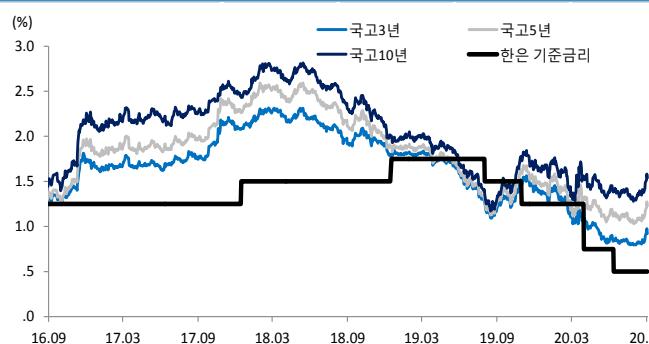
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. 미국 국채 수익률 곡선



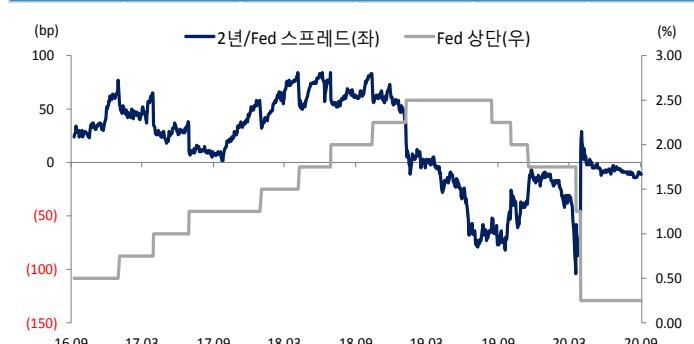
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



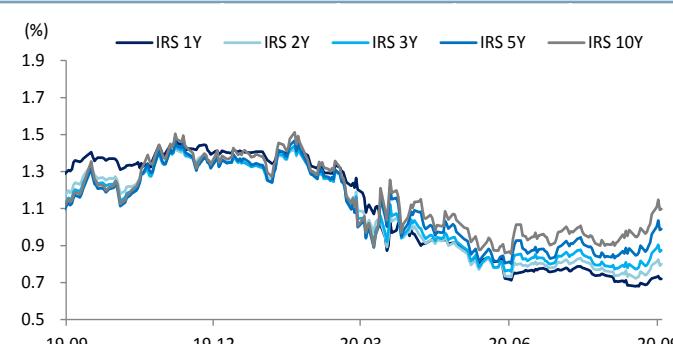
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



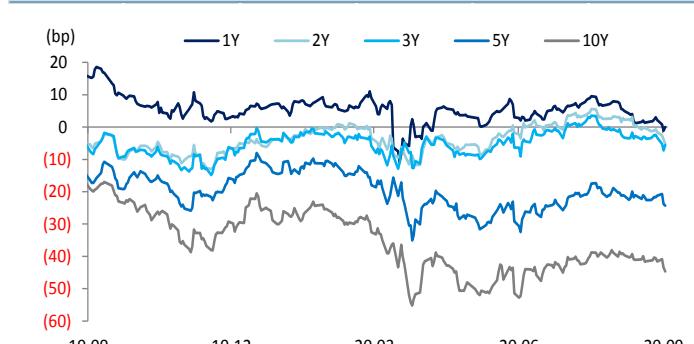
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터