

Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

(단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB009	111.88	▲10	0.03
10KTB009	132.28	▲35	0.20
국고3Y	0.915	▼3.4	-0.01
국고10Y	1.518	▼3.7	-0.02
국고10Y-3Y	60.300	▲0.3	-0.30
KOSPI	2,375.81	▼26.10	▲11.44
USD/KRW	1,189.10	▲2.65	▲3.55

◇ 전일 해외시장 동향

(단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1468	▲0.60	▲1.39
미국5년	0.2817	▲1.43	▲3.01
미국10년	0.7001	▲2.13	▲5.24
미국30년	1.4570	▲3.57	▲7.82
독일10년	-0.462	▲3.30	▲1.10
호주10년	0.972	▲0.45	▲0.20
S&P500	3398.96	▲67.12	▼127.69
USD Index	93.262	▼0.18	▲0.42
WTI	38.05	▲1.29	▼3.46

차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락

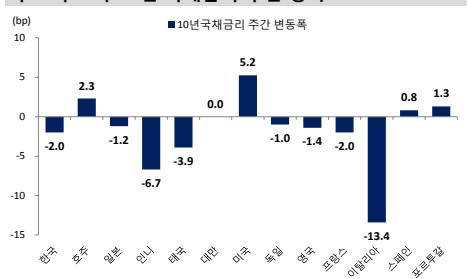
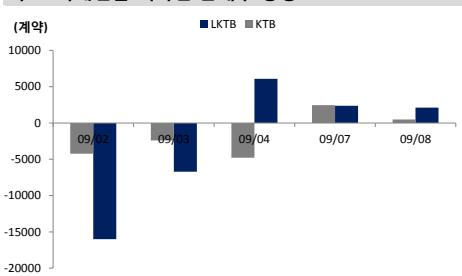


차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/09)

금 일(09/10)

익 일(09/11)

20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수(결과:2.9%, 이전:-2.0%)	08:50 일본 7월 핵심기계수주 MoM(예상:2.0%, 이전:-7.6%) 20:45 유럽 ECB 통화정책회의 기준금리 결정(예상:동결) 21:30 유럽 ECB 라그드 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)	08:50 일본 8월 PPI YoY(예상:-0.5%, 이전:-0.9%) 15:00 영국 7월 산업생산 MoM(예상:4.1%, 이전:9.3%) 15:00 영국 7월 제조업생산 MoM(예상:5.0%, 이전:11.0%) 15:00 독일 8월 CPI YoY(F)(예상:0.0%, 잠정:0.0%) 21:30 미국 8월 CPI YoY(예상:1.2%, 이전:1.0%)
---	--	--

*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	111.94	111.94	111.85	111.88	0.10	0.972%	111.90	-0.02	2.82	101,274	369,628
NKTB012	111.76	111.76	111.68	111.70	0.03	1.029%	111.72	-0.02	2.82	210	4,111
10KTB009	132.64	132.66	132.14	132.28	0.35	1.510%	132.29	-0.01	8.23	61,686	154,208
10KTB012	132.16	132.16	131.80	131.95	0.41	1.540%	131.93	0.02	8.23	392	2,682

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : pt, %)				
이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	
NKTB003	111.78	111.83	112.00	112.08
10KTB003	132.03	132.23	133.07	133.67
KTB3Y	0.937	0.927	0.875	0.842
KTB5Y	1.226	1.215	1.153	1.112
KTB10Y	1.539	1.524	1.452	1.388

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

		NKTB003	10KTB003
	2차 저항	111.98	132.88
	1차 저항	111.93	132.58
PIVOT	PIVOT	111.89	132.36
	1차 지지	111.84	132.06
	2차 지지	111.80	131.84
Demark	High	111.91	132.47
	Low	111.82	131.95

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헛지비율

NKTB009	수익률	3선 헛지비율 10선 헛지비율		NKTB012	수익률	3선 헛지비율 10선 헛지비율		10KTB009	수익률	3선 헛지비율 10선 헛지비율		10KTB012	수익률	3선 헛지비율 10선 헛지비율			
		10.8	20.5			70.9	25.0			86.1	262.5	76.9		283.2	1.502	1.517	83.3
국고 19-7	0.874	70.8	20.5	국고 20-3	0.912	86.1	25.0	국고 19-4	1.502	262.5	76.9	국고 20-4	1.517	283.2	1.517	1.517	83.3
국고 19-3	0.831	55.4	16.1	국고 19-7	0.874	70.9	20.5	국고 19-8	1.512	269.9	79.8	국고 19-8	1.512	269.9	1.512	1.512	79.8
국고 20-1	1.186	139.5	40.5	국고 20-1	1.186	139.8	40.5										

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)			
	금리	전일비	1주대비
			4주대비
CD91일	0.630	0.000	0.000
통안1년	0.687	-0.017	-0.009
국고1년	0.710	-0.023	-0.010
국고3년	0.915	-0.034	-0.008
국고5년	1.190	-0.044	-0.038
국고10년	1.518	-0.037	-0.021
국고20년	1.652	-0.023	-0.048
국고30년	1.636	-0.027	-0.050
국고50년	1.636	-0.028	-0.052
			-0.048

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

		CRS	IRS		CRS-IRS	
		중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
	1년	0.105	0.000	0.748	0.000	-0.643
	2년	0.015	0.000	0.813	-0.003	-0.798
	3년	0.050	0.000	0.880	-0.005	-0.830
	4년	0.080	0.005	0.940	-0.010	-0.860
	5년	0.140	0.015	0.978	-0.015	-0.838
	7년	0.275	0.015	1.018	-0.018	-0.743
	10년	0.380	0.015	1.078	-0.023	-0.698

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)					
일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-900	20,082	-1,584	-540	-137
1주	2,954	6,901	-3,494	8,084	190
2주	-82,820	68,848	5,557	14,222	3,655
4주	-81,348	70,321	15	18,742	1,289
누적	223,343	-169,707	-36,903	-16,123	-11,556

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-4,894	5,071	520	-1,236	299
1주	-9,129	9,367	1,655	-2,995	521
2주	-35,903	23,388	3,567	2,119	1,840
4주	-52,985	33,051	7,710	-1,546	5,087
누적	79,619	-64,908	-1,070	-10,144	-2,809

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



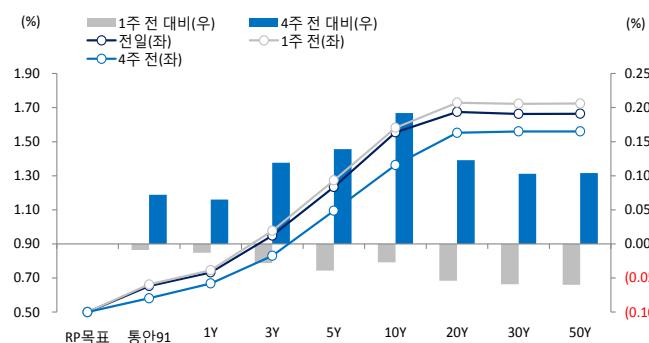
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



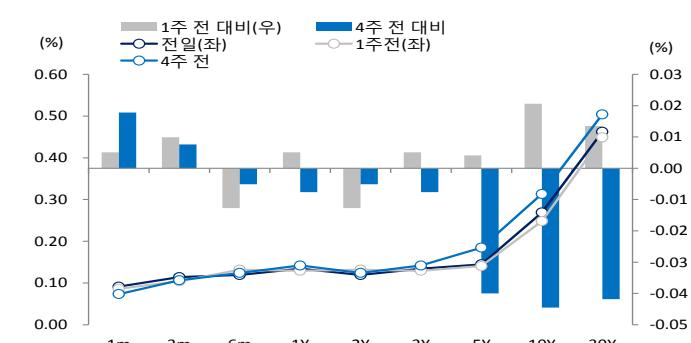
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



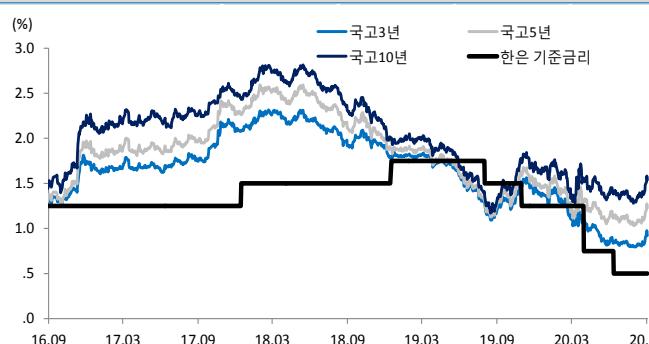
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



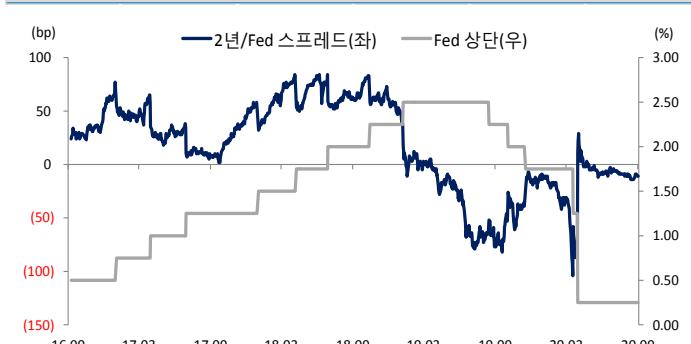
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



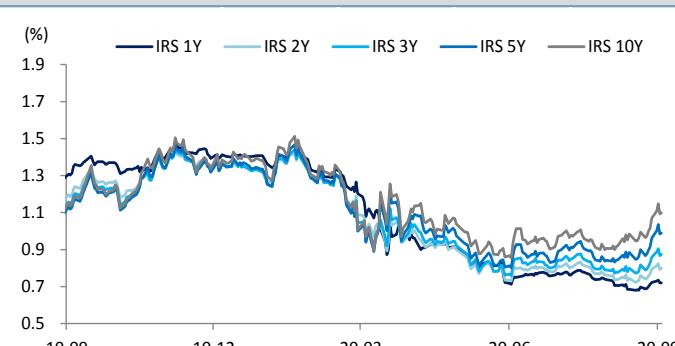
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



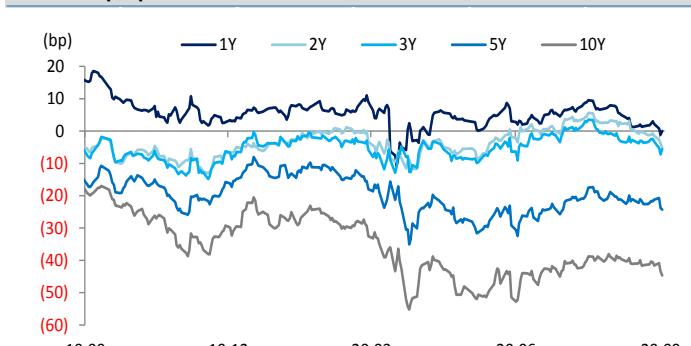
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터