

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	▲5	0.22
10KTB009	132.40	▲25	0.75
국고3Y	0.919	▼0.7	-0.05
국고10Y	1.517	▼1.3	-0.06
국고10Y-3Y	59.800	▲0.6	-0.60
KOSPI	2,427.91	▲31.22	▲43.69
USD/KRW	1,183.60	▼3.30	▼4.65

◇ 전일 해외시장 동향

(단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1370	▲1.00	▼0.58
미국5년	0.2643	▲1.27	▼3.48
미국10년	0.6723	▲0.65	▼4.57
미국30년	1.4116	▲0.00	▼5.98
독일10년	-0.480	▲0.10	▼1.70
호주10년	0.912	▼2.10	▲2.15
S&P500	3383.54	▲42.57	▼43.42
USD Index	93.055	▼0.28	▲0.34
WTI	37.26	▼0.07	▲0.50

차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락

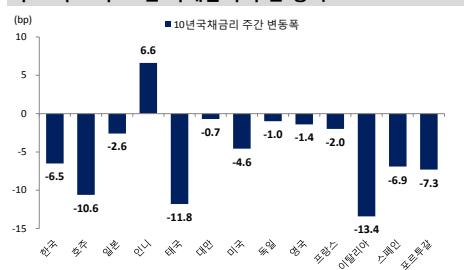
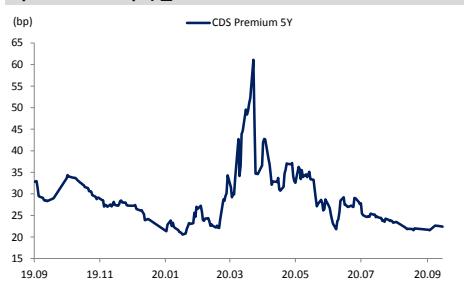


차트. CDS 프리미엄 5Y



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/14)

18:00 유럽 7월 산업생산 MoM(결과: 4.1%, 이전: 9.5%)

금 일(09/15)

11:00 중국 8월 산업생산 YoY(예상: 5.1%, 이전: 4.8%)
 11:00 중국 8월 소매판매 YoY(예상: 0.0%, 이전: -1.1%)
 18:00 독일 9월 ZEW 서비스(예상: 70.0, 이전: 71.5)
 21:30 미국 9월 엠파이어스테이트 제조업지수(예상: 4.4, 이전: 3.7)
 22:15 미국 8월 산업생산 MoM(예상: 71.7%, 이전: 70.6%)

의 일(09/16)

15:00 영국 8월 CPI YoY(예상: 0.0%, 이전: 1.0%)
 20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수(예상: -, 이전: 2.9%)
 21:30 미국 8월 소매판매 MoM(예상: 1.0%, 이전: 1.2%)
 23:30 미국 DOE 주간 원유재고(예상: -, 이전: 2033k)
 (09/17)
 03:00 미국 FOMC 기준금리 결정(예상: 기준금리 동결)
 03:30 미국 Fed 제롬 파월 의장 연설

KTB Futures

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	미결제약정
NKTB009	111.85	111.90	111.80	111.88	0.05	0.972%	111.90	-0.02	2.82	74,986	65,581
NKTB012	111.68	111.72	111.62	111.70	0.05	1.029%	111.72	-0.02	2.82	58,372	316,275
10KTB009	132.18	132.45	132.07	132.40	0.25	1.499%	132.34	0.06	8.23	48,357	27,610
10KTB012	131.85	132.15	131.75	132.06	0.24	1.530%	131.99	0.07	8.23	33,074	137,539

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	
	60MA			
NKTB003	111.85	111.81	111.95	112.08
10KTB003	132.20	132.07	132.82	133.61
KTB3Y	0.925	0.935	0.890	0.845
KTB5Y	1.217	1.229	1.173	1.116
KTB10Y	1.527	1.538	1.473	1.394

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

	NKTB003	10KTB003
2차저항	111.96	132.69
1차저항	111.92	132.54
PIVOT	PIVOT	132.31
1차지지	111.82	132.16
2차지지	111.76	131.93
Demark	High	132.62
Low	111.94	132.24

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헛지비율

NKTB009	수익률	3선 헛지비율		10KTB009	수익률	3선 헛지비율		10KTB012	수익률	3선 헛지비율	
		10선 헛지비율	10선 헛지비율			10선 헛지비율	10선 헛지비율			10선 헛지비율	10선 헛지비율
국고 19-7	0.879	70.3	20.4	국고 20-3	0.917	85.7	24.8	국고 19-4	1.500	262.4	76.7
국고 19-3	0.834	54.9	15.9	국고 19-7	0.879	70.5	20.4	국고 19-8	1.509	270.0	79.6
국고 20-1	1.181	139.2	40.4	국고 20-1	1.181	139.4	40.4				

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	0.630	0.000	0.000	0.000
통안1년	0.691	-0.001	-0.027	-0.013
국고1년	0.709	-0.005	-0.039	-0.024
국고3년	0.919	-0.007	-0.054	-0.030
국고5년	1.217	-0.011	-0.046	-0.017
국고10년	1.517	-0.013	-0.055	-0.038
국고20년	1.659	0.014	-0.041	-0.016
국고30년	1.662	0.011	-0.029	-0.001
국고50년	1.661	0.009	-0.030	-0.003

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

	CRS		IRS		CRS-IRS	
	중간값	전일비	중간값	전일비	Basis	
1년	0.105	0.000	0.735	-0.010	-0.630	
2년	0.020	0.000	0.818	-0.013	-0.798	
3년	0.060	0.000	0.888	-0.015	-0.828	
4년	0.105	0.000	0.943	-0.018	-0.838	
5년	0.180	0.010	0.978	-0.018	-0.798	
7년	0.315	0.010	1.020	-0.018	-0.705	
10년	0.420	0.010	1.080	-0.018	-0.660	

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	3,836	-10,795	457	6,692	655
1주	192	17,395	-1,289	3,915	706
2주	-34,577	35,898	-785	15,427	2,213
4주	-79,488	63,687	4,017	24,533	4,166
누적	222,329	-171,612	-37,149	-10,123	-10,607

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	7,027	-8,688	625	1,111	-141
1주	4,437	-2,444	74	-812	27
2주	-7,464	6,767	1,199	-237	65
4주	-27,248	15,238	3,817	101	3,095
누적	88,463	-72,468	-1,531	-9,249	-3,076

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



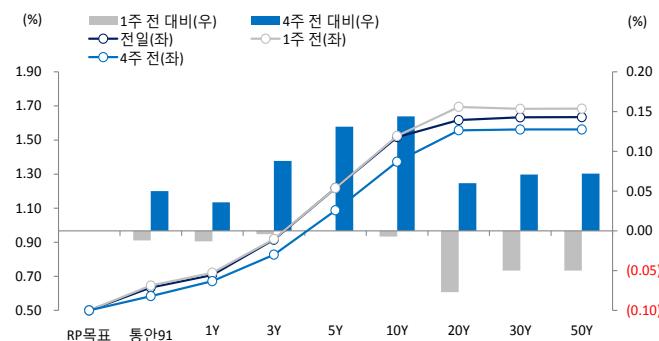
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



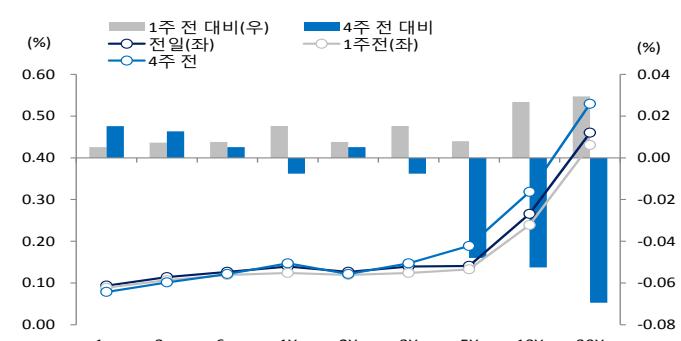
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



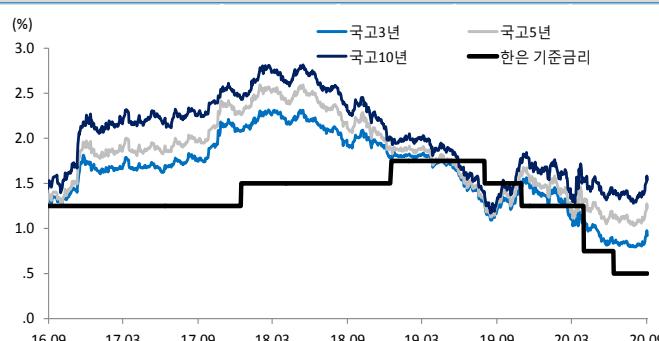
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



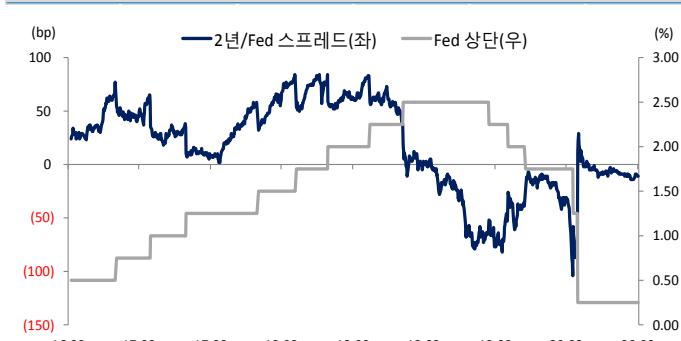
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



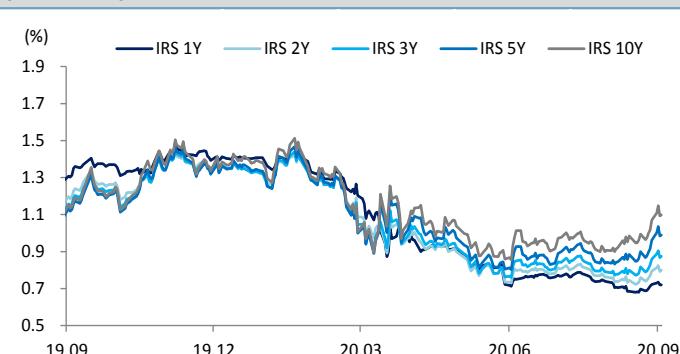
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



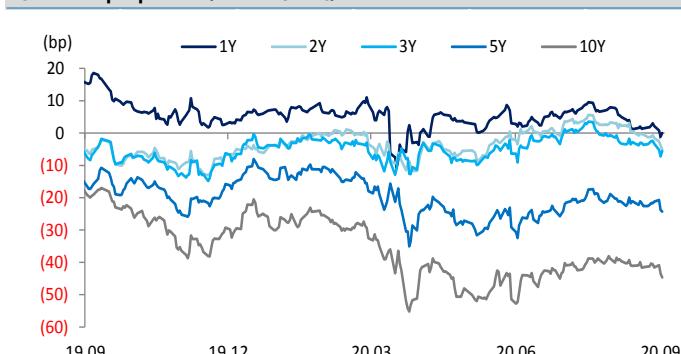
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터