

Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

(단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB012	111.78	▲0	0.08
10KTB012	132.25	▼15	0.33
국고3Y	0.914	▲0.4	-0.00
국고10Y	1.508	▲2.3	-0.01
국고10Y-3Y	59.400	▼1.9	1.90
KOSPI	2,406.17	▼29.75	▲9.69
USD/KRW	1,174.40	▼1.65	▼10.50

◇ 전일 해외시장 동향

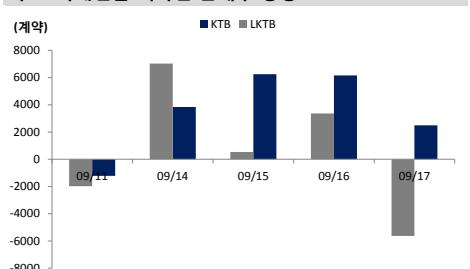
(단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1350	▼0.20	▼0.39
미국5년	0.2770	▼0.48	▲0.96
미국10년	0.6887	▼0.82	▲1.15
미국30년	1.4388	▼2.02	▲2.01
독일10년	-0.491	▼0.70	▼5.80
호주10년	0.868	▲0.25	▼2.40
S&P500	3357.01	▼28.48	▲17.82
USD Index	92.912	▼0.30	▼0.42
WTI	40.97	▲0.81	▲3.64

차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락



차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/17)

- 18:00 유럽 8월 CPI YoY(결과:-0.2%, 예상:-0.2%)
 21:30 미국 8월 주택착공건수(결과:1416k, 예상:1492k)
 21:30 미국 9월 필라델피아 연준 경기전망(결과:15.0, 예상:17.2)
 21:30 미국 주간 신규실업수당 청구건수(결과:860k, 예상:893k)

금 일(09/18)

- 08:30 일본 8월 CPI YoY(예상:0.2%, 이전:0.3%)
 15:00 영국 8월 소매판매 MoM(예상:0.8%, 이전:3.6%)
 15:00 독일 8월 PPI YoY(예상:-1.4%, 이전:-1.7%)
 21:30 미국 2분기 경상수지(예상:\$160.0b, 이전:\$104.2b)
 23:00 미국 8월 선행지수 MoM(예상:1.3%, 이전:1.4%)
 23:00 미국 9월 미시간대학 소비자신뢰(P)(예상:75.0, 이전:74.1)

의 일(09/21)

- 09:00 한국 9월 수출 20일 YoY(예상:--, 이전:-7.0%)
 10:30 중국 인민은행 대출우대금리 결정(예상:동결)
 21:30 미국 8월 시카고 연은 국가활동지수(예상:1.18, 이전:1.18)

KTB Futures

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	(단위 : pt, %, 계약) 미결제약정
NKTB012	111.78	111.79	111.74	111.78	0.00	1.004%	111.76	0.02	2.82	65,975	354,502
NKTB103	111.63	111.63	111.63	111.63	0.00	1.052%	111.63	0.00	2.82	-	-
10KTB012	132.39	132.43	132.05	132.25	-0.15	1.513%	132.13	0.12	8.23	51,542	153,578
10KTB103	131.91	131.91	131.91	131.91	0.14	1.544%	131.86	0.05	8.23	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : pt, %)			
이동평균선			
	5MA	10MA	20MA
NKTB012	111.81	111.80	111.89
10KTB012	132.29	132.16	132.54
KTB3Y	0.915	0.926	0.905
KTB5Y	1.206	1.216	1.191
KTB10Y	1.509	1.523	1.494
			1.400

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

NKTB012		10KTB012	
	2차저항	111.82	132.62
	1차저항	111.80	132.44
PIVOT	PIVOT	111.77	132.24
	1차지지	111.75	132.06
	2차지지	111.72	131.86
Demark	High	111.81	132.34
	Low	111.76	131.96

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헛지비율

NKTB012	수익률	3선 헛지비율		NKTB103	수익률	3선 헛지비율		10KTB009	수익률	3선 헛지비율	
		10선 헛지비율	3선 헛지비율			10선 헛지비율	3선 헛지비율			10선 헛지비율	3선 헛지비율
국고 20-3	0.913	85.3 24.7	85.3 24.7	국고 20-3	0.913	85.3 24.7	85.3 24.7	국고 20-4	1.503	284.3 82.3	284.3 82.3
국고 19-7	0.865	70.1 20.3	70.1 20.3	국고 19-7	0.865	70.1 20.3	70.1 20.3	국고 19-8	1.495	270.9 78.4	270.9 78.4
국고 20-1	1.158	139.2 40.3	139.2 40.3	국고 20-6	1.195	152.5 44.1	152.5 44.1				

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)			
	금리	전일비	1주대비
			4주대비
CD91일	0.630	0.000	0.000
통안1년	0.688	0.005	0.004 -0.004
국고1년	0.705	0.005	-0.003 -0.009
국고3년	0.914	0.004	-0.001 -0.012
국고5년	1.197	0.009	-0.021 -0.031
국고10년	1.508	0.023	-0.009 -0.022
국고20년	1.624	0.024	-0.007 -0.021
국고30년	1.631	0.016	-0.002 -0.020
국고50년	1.628	0.013	-0.006 -0.024

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

		CRS	IRS		CRS-IRS	
		중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
	1년	0.140	0.010	0.738	0.005	-0.598
	2년	0.050	0.010	0.803	0.005	-0.753
	3년	0.085	0.010	0.868	0.005	-0.783
	4년	0.135	0.010	0.923	0.008	-0.788
	5년	0.220	0.015	0.958	0.010	-0.738
	7년	0.365	0.025	0.998	0.010	-0.633
	10년	0.480	0.035	1.063	0.013	-0.583

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)					
일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	2,492	-7,465	2,831	312	222
1주	17,520	-23,743	1,346	3,490	1,133
2주	23,550	-18,091	-514	11,110	619
4주	-68,777	49,505	4,606	24,892	4,574
누적	237,231	-190,706	-35,862	-9,787	-10,464

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-5,625	4,321	-39	542	-136
1주	3,325	-5,966	-225	-42	-99
2주	383	-865	-451	-2,097	294
4주	-28,582	18,218	1,786	-1,683	2,514
누적	86,733	-72,090	-2,168	-10,472	-3,079

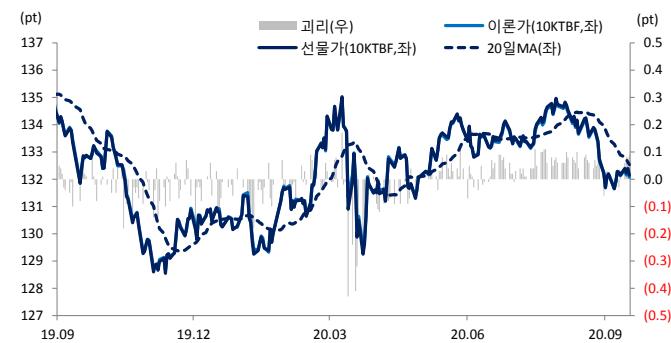
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



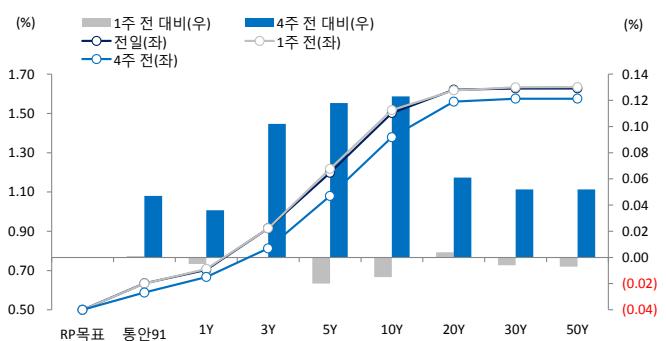
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



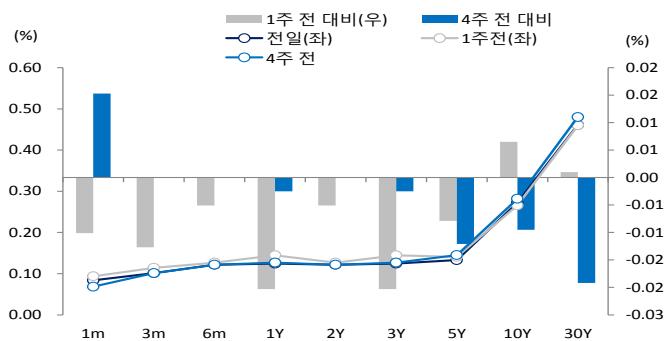
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



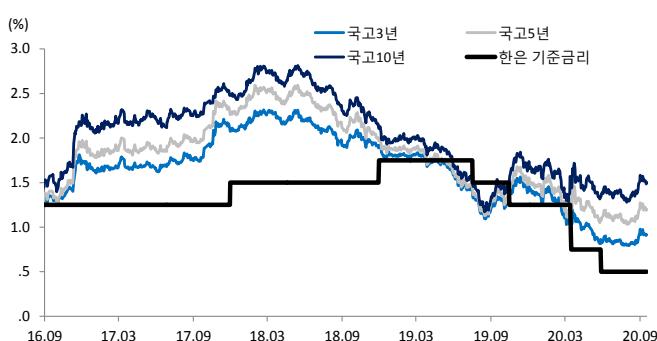
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



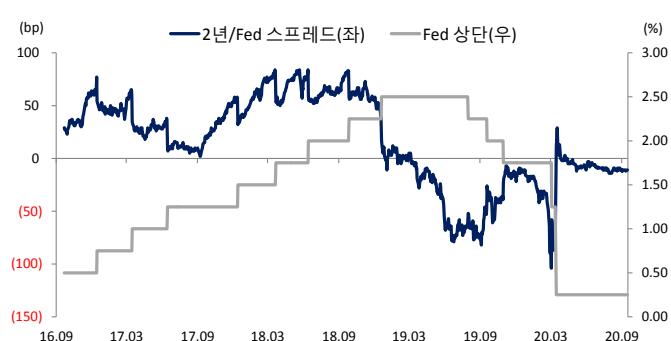
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



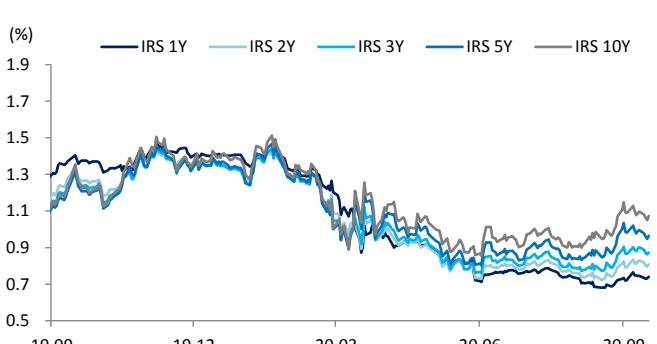
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



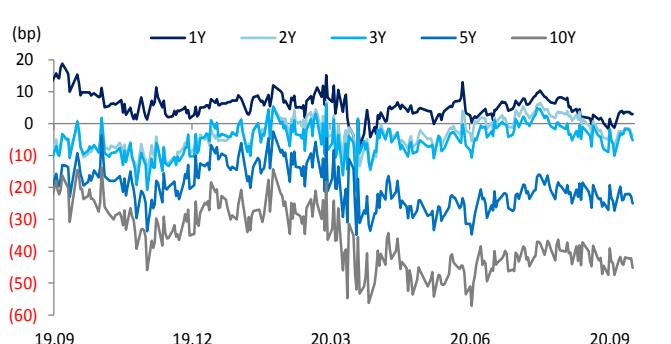
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터