

Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향 (단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB012	111.96	▼12	-0.09
10KTB012	132.51	▼61	-0.61
국고3Y	0.881	▲3.5	0.04
국고10Y	1.479	▲4.9	0.05
국고10Y-3Y	59.800	▼1.4	1.40
KOSPI	2,358.00	▲30.11	▲24.76
USD/KRW	1,163.40	▼6.20	▼0.95

◇ 전일 해외시장 동향 (단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1447	▲1.58	▲1.97
미국5년	0.3354	▲4.91	▲7.75
미국10년	0.7817	▲8.12	▲12.89
미국30년	1.5892	▲10.24	▲17.43
독일10년	-0.510	▲2.60	▲1.80
호주10년	0.833	▼6.35	▲3.50
S&P500	3408.63	▲60.19	▲57.03
USD Index	93.466	▼0.38	▼0.81
WTI	39.35	▲2.30	▲0.06

차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락

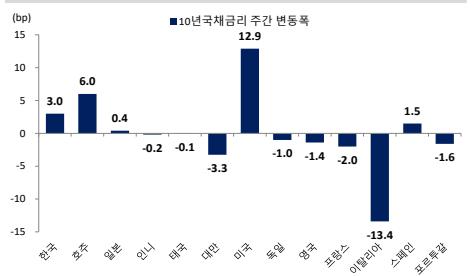
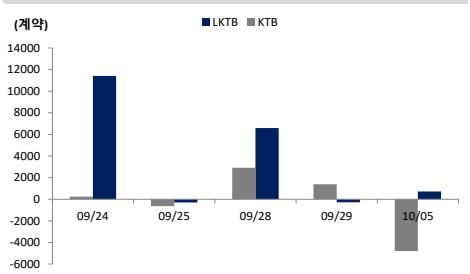


차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



출처 : Bloomberg, 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(10/05)

- 16:55 독일 9월 마킷 종합 PMI(F)(결과: 54.7, 잠정: 53.7)
 17:00 유로존 9월 마킷 종합 PMI(F)(결과: 50.4, 잠정: 50.1)
 18:00 유로존 8월 소매판매 MoM(결과: 4.4%, 이전: -1.8%)
 22:45 미국 9월 마킷 종합 PMI(F)(결과: 54.3, 잠정: 54.4)
 23:00 미국 9월 ISM 서비스지수(결과: 57.8, 이전: 56.9)

금 일(10/06)

- 08:00 한국 9월 CPI YoY(예상: 0.4%, 이전: 0.7%)
 15:00 독일 8월 제조업수주 MoM(예상: 2.9%, 이전: 2.8%)
 21:30 미국 8월 무역수지(예상: -\$64.9b, 이전: -\$63.6b)
 22:00 유럽 ECB 라가르드 총재 연설
 (10/06)
 00:30 유럽 ECB 필립 레인 수석 이코노미스트 연설
 00:45 미국 Fed 패트릭 하커(필라델피아, 투표권) 총재 연설

익 일(10/07)

- 15:00 독일 8월 산업생산 MoM(예상: 1.7%, 이전: 1.2%)
 20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수(예상: -, 이전: -4.8%)
 23:30 미국 DOE 주간 원유재고(예상: -, 이전: -1980k)
 (10/08)
 03:00 미국 FOMC 회의록
 04:00 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권) 총재 연설
 05:30 미국 Fed 칠스 에반스(시카고) 총재 연설

*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	미결제약정
NKTB012	112.03	112.04	111.94	111.96	-0.12	0.947%	111.92	0.04	2.82	99,500	417,866
NKTB103	111.92	111.92	111.92	111.92	0.01	0.960%	111.80	0.12	2.82	-	-
10KTB012	132.90	132.97	132.41	132.51	-0.61	1.489%	132.44	0.07	8.24	56,192	162,858
10KTB103	132.50	132.50	132.50	132.50	-0.37	1.490%	132.18	0.32	8.24	2	6

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : pt, %)				
이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	
NKTB012	112.03	111.93	111.87	112.04
10KTB012	133.00	132.72	132.44	133.42
KTB3Y	0.856	0.879	0.902	0.855
KTB5Y	1.125	1.154	1.186	1.127
KTB10Y	1.439	1.462	1.493	1.413

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

NKTB012		10KTB012
2차저항	112.08	133.19
1차저항	112.02	132.85
PIVOT	PIVOT	132.63
1차지지	111.92	132.29
2차지지	111.88	132.07
Demark	High	132.74
	Low	132.18

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	0.877	83.7	83.7	국고 20-3	0.877	24.2	24.2	국고 20-4	1.480	283.0	283.0
국고 19-7	0.826	68.5	68.5	국고 19-7	0.826	19.8	19.8	국고 19-8	1.470	269.6	269.6
국고 20-1	1.105	137.7	137.7	국고 20-6	1.146	39.8	43.7			78.0	78.0

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)				
	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	0.630	0.000	0.000	0.000
통안1년	0.692	0.018	0.021	0.019
국고1년	0.679	0.011	0.011	0.005
국고3년	0.881	0.035	0.038	0.024
국고5년	1.147	0.040	0.030	0.018
국고10년	1.479	0.049	0.053	0.042
국고20년	1.615	0.051	0.053	0.021
국고30년	1.626	0.049	0.051	0.032
국고50년	1.626	0.050	0.051	0.033

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

		CRS	IRS		CRS-IRS	
		증간값	전일비	증간값	전일비	Basis
	1년	0.065	-0.015	0.720	0.003	-0.655
	2년	-0.045	0.020	0.788	0.018	-0.833
	3년	-0.040	0.020	0.848	0.028	-0.888
	4년	-0.015	0.020	0.900	0.040	-0.915
	5년	0.050	0.020	0.940	0.050	-0.890
	7년	0.200	0.020	0.980	0.053	-0.780
	10년	0.315	0.020	1.045	0.055	-0.730

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)					
일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	731	-4,672	1,721	2,419	-195
1주	18,186	-17,797	-1,571	3,157	-372
2주	51,579	-39,282	111	-9,763	-181
4주	65,929	-45,915	-5,173	4,345	879
누적	286,318	-222,523	-38,582	-19,862	-10,867

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-4,786	3,628	-227	791	239
1주	-868	3,424	-1,312	-395	-832
2주	8,536	-2,585	-3,305	-707	-2,012
4주	12,146	-4,721	-2,709	-4,572	-1,625
누적	100,894	-78,996	-5,434	-11,721	-4,955

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



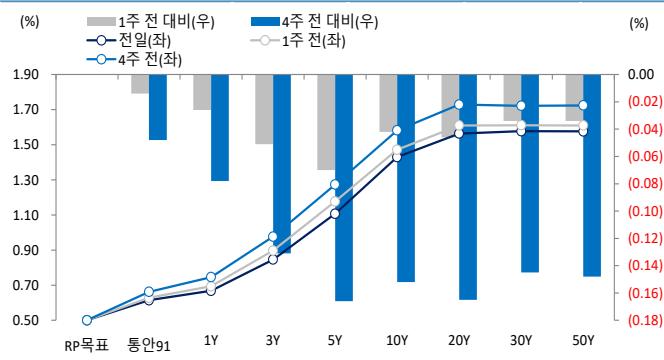
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



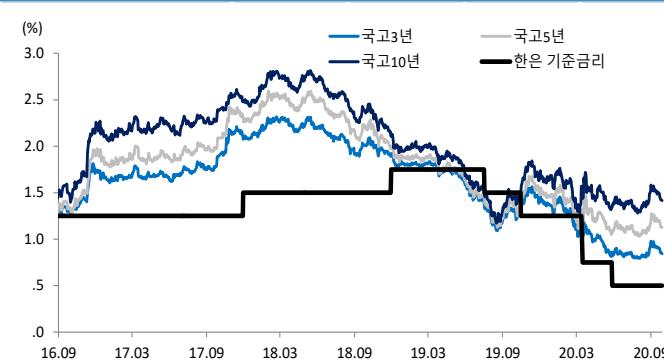
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



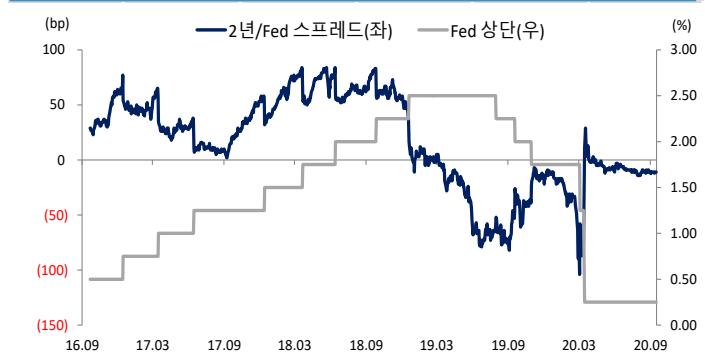
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



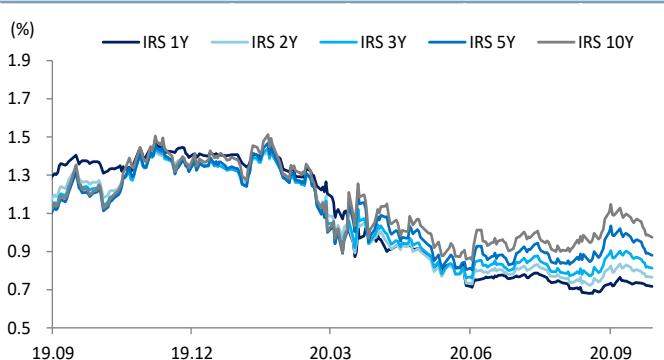
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



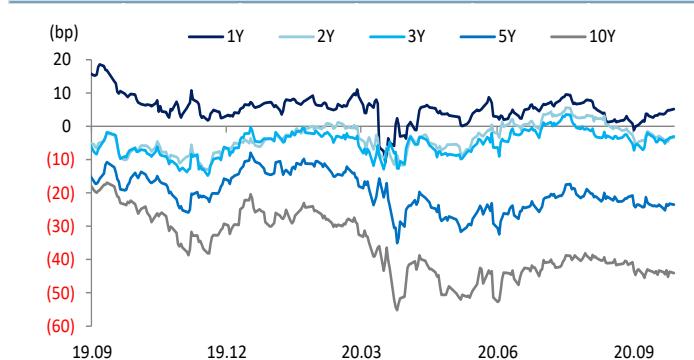
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터