

Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향 (단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB012	111.80	▼2	-0.28
10KTB012	131.90	▼2	-1.22
국고3Y	0.910	▲0.5	0.06
국고10Y	1.533	▲0.2	0.10
국고10Y-3Y	62.300	▲0.3	-0.30
KOSPI	2,386.94	▲21.04	▲108.15
USD/KRW	1,158.30	▼2.75	▼14.20

◇ 전일 해외시장 동향 (단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1507	▲0.40	▲2.37
미국5년	0.3419	▲3.02	▲6.51
미국10년	0.7868	▲5.15	▲10.28
미국30년	1.5859	▲4.93	▲13.07
독일10년	-0.493	▲1.40	▲2.90
호주10년	0.840	▼4.48	▲5.22
S&P500	3419.45	▲58.50	▲56.45
USD Index	93.621	▼0.07	▼0.27
WTI	39.95	▼0.72	▲1.23

차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락

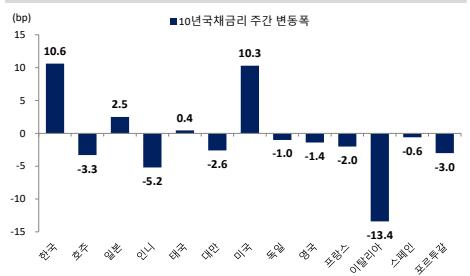
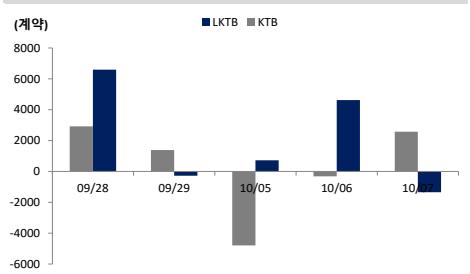


차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



출처 : Bloomberg, 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(10/07)

- 20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수(결과: 4.6%, 이전:-4.8%)
 23:30 미국 DOE 주간 원유재고(결과: 501k, 이전:-1980k)
 (10/08)
 03:00 미국 FOMC 회의록 공개
 04:00 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권) 총재 연설
 05:30 미국 Fed 찰스 에반스(시카고) 총재 연설

금 일(10/08)

- 10:45 중국 9월 차이신 종합 PMI(예상: -, 이전: 55.1)
 10:45 중국 9월 차이신 서비스업 PMI(예상: -, 이전: 54.0)
 17:00 유럽 ECB 루이 데 콘도스 부총재 연설
 21:30 미국 주간 신규실업수당 청구건수(예상: 820k, 이전: 837k)

익 일(10/12)

- 08:50 일본 9월 PPI YoY(예상: -, 이전: -0.5%)
 08:50 일본 8월 핵심기계수주 MoM(예상: -, 이전: 6.3%)

KTB Futures

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	(단위 : pt, %, 계약) 미결제약정
NKTB012	111.86	111.89	111.80	111.80	-0.02	0.998%	111.80	0.00	2.82	96,277	417,254
NKTB103	111.72	111.72	111.72	111.72	-0.11	1.023%	111.68	0.04	2.82	-	-
10KTB012	132.18	132.18	131.88	131.90	-0.02	1.545%	131.86	0.04	8.23	61,336	164,025
10KTB103	132.00	132.00	132.00	132.00	0.00	1.536%	131.59	0.41	8.23	-	8

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : pt, %)				
이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	
NKTB012	111.94	111.94	111.87	112.04
10KTB012	132.51	132.66	132.42	133.37
KTB3Y	0.877	0.878	0.901	0.857
KTB5Y	1.154	1.155	1.184	1.130
KTB10Y	1.480	1.467	1.494	1.418

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

NKTB012		10KTB012
2차저항	111.92	132.29
1차저항	111.86	132.09
PIVOT	PIVOT	131.99
1차지지	111.77	131.79
2차지지	111.74	131.69
Demark	High	132.04
	Low	131.74

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	0.908	83.6	83.6	국고 20-3	0.908	24.3	24.3	국고 20-4	1.533	281.8	281.8
국고 19-7	0.845	68.5	68.5	국고 19-7	0.845	19.8	19.8	국고 19-8	1.523	268.6	268.6
국고 20-1	1.167	137.4	137.4	국고 20-6	1.200	39.9	43.8			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	0.702	-0.004	0.028	0.031
국고1년	0.685	-0.002	0.017	0.017
국고3년	0.910	0.005	0.064	0.067
국고5년	1.200	0.001	0.093	0.083
국고10년	1.533	0.002	0.103	0.107
국고20년	1.662	-0.004	0.098	0.100
국고30년	1.675	-0.006	0.098	0.100
국고50년	1.675	-0.006	0.099	0.100

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

		CRS	IRS		CRS-IRS	
		증간값	전일비	증간값	전일비	Basis
1년		0.100	0.020	0.725	0.000	-0.625
2년		0.040	0.050	0.798	-0.003	-0.758
3년		0.050	0.050	0.868	-0.003	-0.818
4년		0.080	0.050	0.925	-0.003	-0.845
5년		0.160	0.055	0.965	-0.008	-0.805
7년		0.310	0.055	1.010	-0.010	-0.700
10년		0.425	0.055	1.080	-0.015	-0.655

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)					
일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-1,343	1,130	-816	470	270
1주	10,336	-17,229	-921	4,924	420
2주	49,610	-49,084	-1,023	-500	400
4주	69,834	-57,720	-1,305	6,330	1,012
누적	289,601	-235,224	-37,565	-15,617	-10,005

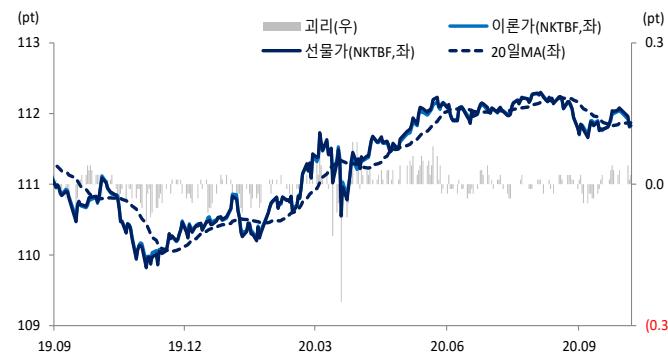
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	2,575	-1,508	-52	-696	-148
1주	1,781	-2,359	-224	1,023	31
2주	15,305	-8,861	-2,586	-722	-1,981
4주	21,572	-13,709	-3,528	-3,677	-1,731
누적	103,152	-82,038	-5,055	-11,084	-4,959

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



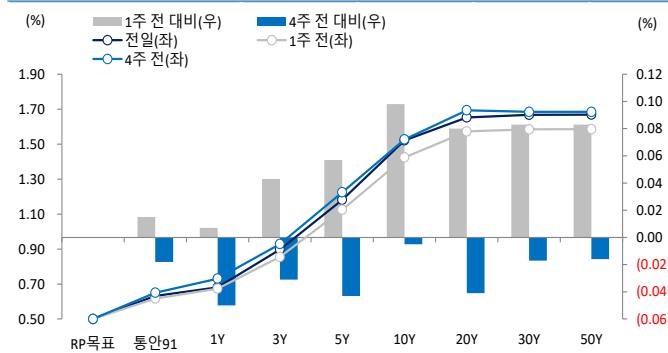
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



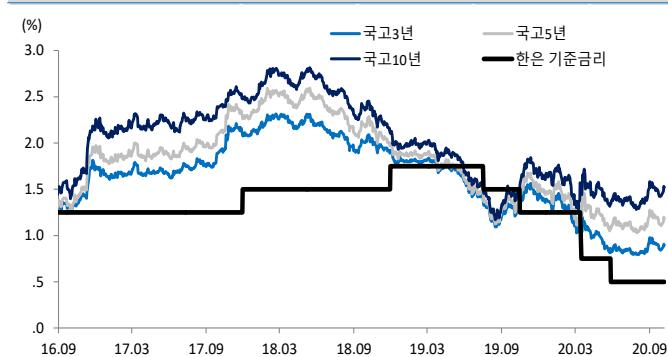
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



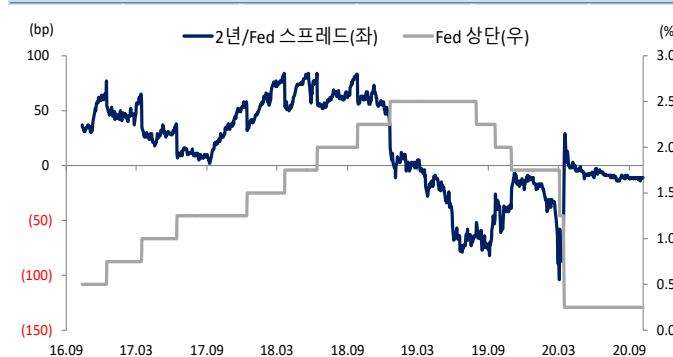
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



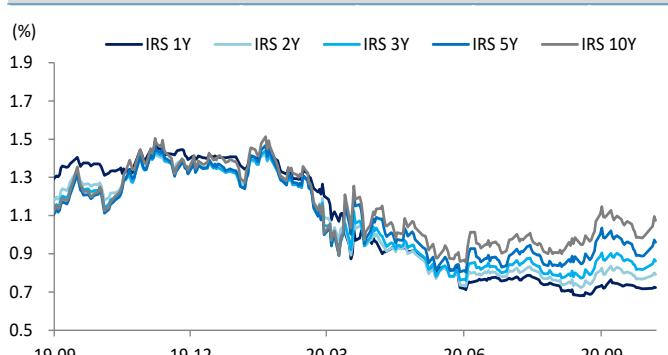
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



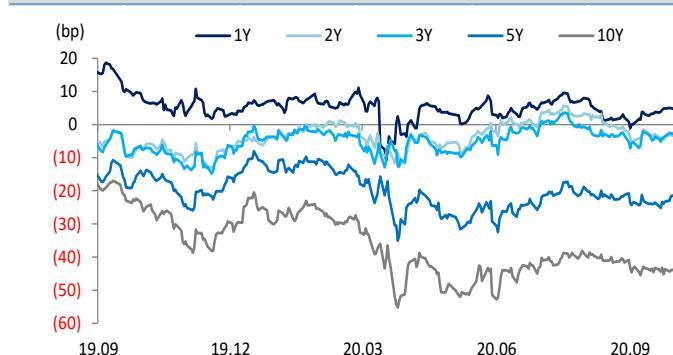
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터