

Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향 (단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB012	111.77	▼6	-0.19
10KTB012	131.72	▼14	-0.79
국고3Y	0.925	▲1.8	0.04
국고10Y	1.553	▲1.0	0.07
국고10Y-3Y	62.800	▲0.8	-0.80
KOSPI	2,403.73	▲11.77	▲75.84
USD/KRW	1,147.00	▼6.40	▼22.60

◇ 전일 해외시장 동향 (단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1529	▲0.00	▲0.82
미국5년	0.3374	▲0.00	▲0.20
미국10년	0.7737	▲0.00	▼0.80
미국30년	1.5717	▲0.00	▼1.75
독일10년	-0.545	▼1.80	▼3.50
호주10년	0.847	▼0.35	▲1.40
S&P500	3534.22	▲57.09	▲125.59
USD Index	93.052	▼0.00	▼0.46
WTI	39.43	▼1.17	▼1.24

차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락

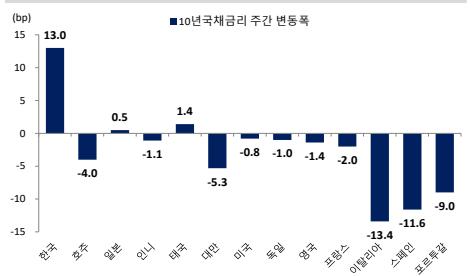
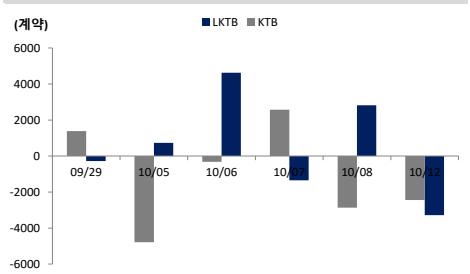


차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



출처 : Bloomberg, 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(10/12)

금 일(10/13)

익 일(10/14)

15:00 일본 8월 공작기계수주 MoM(P)(잠정:-15.0%, 이전:-23.2%)	15:00 독일 9월 CPI YoY(F)(예상:--, 잠정:-0.2%) 18:00 독일 10월 ZEW 서베이(예상:--, 이전:77.4) 19:00 미국 9월 NFIB 소기업 낙관지수(예상:101.2, 이전:100.2) 21:30 미국 9월 CPI YoY(예상:1.4%, 이전:1.3%) N/A 중국 9월 수출 YoY(예상:9.5%, 이전:9.5%) N/A 중국 9월 수입 YoY(예상:-0.3%, 이전:-2.1%) N/A 중국 9월 무역수지(예상:\$59.25b, 이전:\$58.93b)	08:30 호주 10월 웨스트팩 소비자기대지수(예상:--, 이전:93.8) 13:30 일본 8월 산업생산 MoM(F)(예상:--, 이전:9.6%) 20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수(예상:--, 이전:4.6%) 21:30 미국 9월 PPI YoY(예상:0.2%, 이전:-0.2%) 22:00 미국 Fed 리처드 클라리다 부의장 연설 23:30 미국 Fed 랜들 월스 부의장 연설 N/A 한국은행 10월 금통위 기준금리 결정(예상:기준금리 동결)
---	---	---

*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
NKTB012	111.83	111.83	111.75	111.77	-0.06	1.007%	111.76	0.01	2.82	73,897	408,879
NKTB103	111.65	111.65	111.65	111.65	-0.07	1.045%	111.63	0.02	2.82	-	-
10KTB012	131.86	131.91	131.65	131.72	-0.14	1.562%	131.65	0.07	8.23	44,980	159,937
10KTB103	131.85	131.85	131.85	131.85	0.00	1.550%	131.36	0.49	8.23	-	10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : pt, %)				
이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	
NKTB012	111.84	111.93	111.88	112.03
10KTB012	131.98	132.53	132.42	133.32
KTB3Y	0.906	0.881	0.896	0.859
KTB5Y	1.196	1.161	1.181	1.133
KTB10Y	1.528	1.480	1.492	1.422

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

NKTB012		10KTB012
2차저항	111.86	132.02
1차저항	111.82	131.87
PIVOT	PIVOT	131.76
1차지지	111.74	131.61
2차지지	111.70	131.50
Demand	High	131.82
	Low	131.56

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	0.924	83.2	83.2	국고 20-3	0.924	24.2	24.2	국고 20-4	1.555	280.9	280.9
국고 19-7	0.850	68.0	68.0	국고 19-7	0.850	19.8	19.8	국고 19-8	1.543	267.8	267.8
국고 20-1	1.184	136.9	136.9	국고 20-6	1.225	39.8	43.7			77.9	77.9

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	0.003	0.010	0.010
국고1년	0.690	0.007	0.011	0.011
국고3년	0.925	0.018	0.044	0.044
국고5년	1.225	0.018	0.078	0.078
국고10년	1.553	0.010	0.074	0.074
국고20년	1.660	0.000	0.045	0.045
국고30년	1.665	-0.005	0.039	0.039
국고50년	1.665	-0.005	0.039	0.039

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

	CRS		IRS		CRS-IRS
	증간값	전일비	증간값	전일비	Basis
1년	0.105	0.005	0.705	-0.013	-0.600
2년	0.065	0.010	0.790	-0.005	-0.725
3년	0.085	0.020	0.870	0.003	-0.785
4년	0.110	0.020	0.938	0.008	-0.828
5년	0.190	0.020	0.980	0.008	-0.790
7년	0.340	0.020	1.028	0.010	-0.688
10년	0.455	0.020	1.093	0.010	-0.638

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)					
일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-3,277	1,902	228	1,717	-42
1주	3,557	-18,785	3,434	8,546	640
2주	38,945	-40,975	-287	1,923	21
4주	64,901	-46,847	-1,550	1,848	1,387
누적	289,144	-236,636	-36,869	-13,735	-10,032

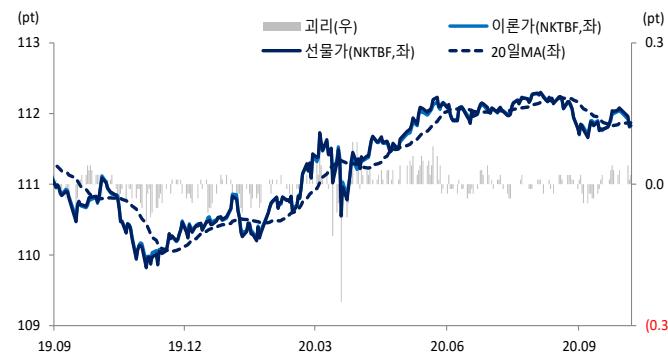
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-2,439	1,985	-271	70	269
1주	-7,833	5,862	-305	773	873
2주	4,473	-751	-2,267	-477	-976
4주	13,334	-6,783	-3,922	-2,831	-1,213
누적	97,847	-76,762	-5,512	-11,739	-4,321

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



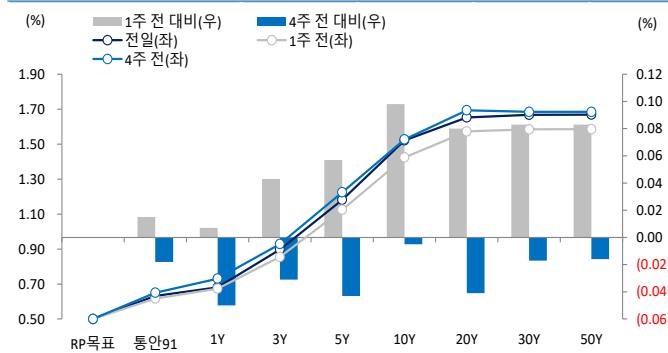
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



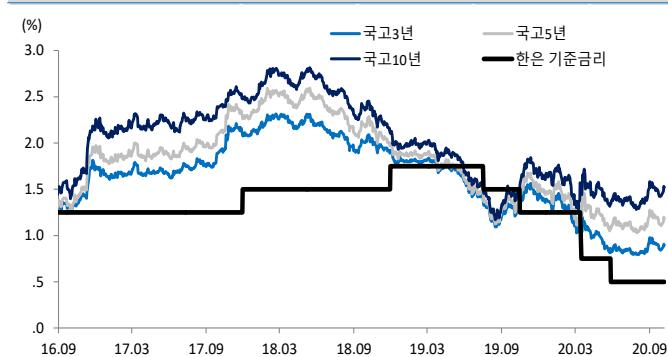
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



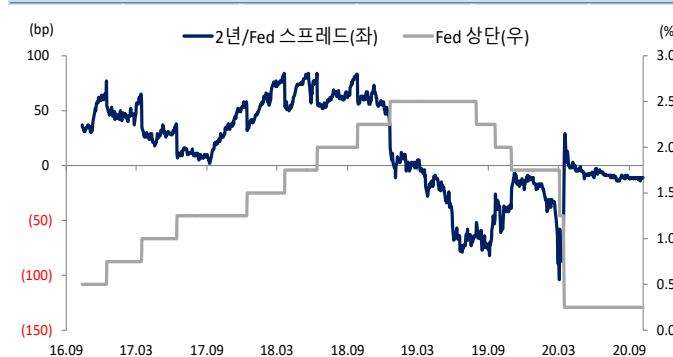
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



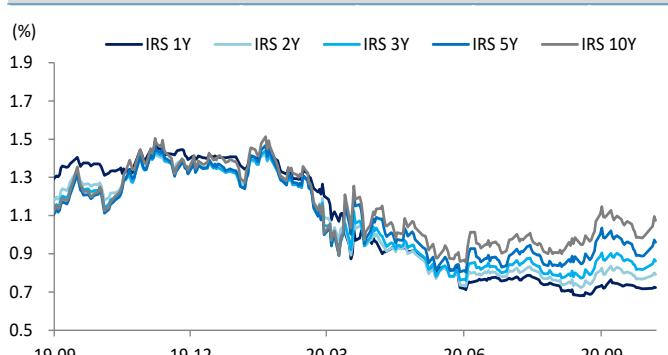
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



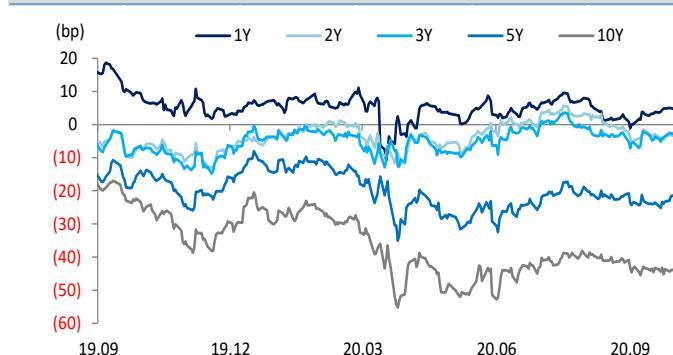
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터