

Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향 (단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
NKTB012	111.99	▲12	0.16
10KTB012	132.65	▲47	0.79
국고3Y	0.877	▼2.4	-0.03
국고10Y	1.478	▼3.5	-0.06
국고10Y-3Y	60.100	▲1.1	-1.10
KOSPI	2,361.21	▼19.27	▼25.73
USD/KRW	1,143.25	▼3.65	▼15.05

◇ 전일 해외시장 동향 (단위 : %, bp, pt, USD)

종목	전일종가	전일대비	전주대비
미국2년	0.1390	▲0.00	▼1.18
미국5년	0.3136	▲0.96	▼2.36
미국10년	0.7322	▲0.66	▼5.30
미국30년	1.5134	▲0.80	▼7.32
독일10년	-0.610	▼2.90	▼8.70
호주10년	0.766	▼7.18	▼10.00
S&P500	3483.34	▼5.33	▲36.51
USD Index	93.783	▲0.40	▲0.18
WTI	40.96	▼0.08	▲0.36

차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락

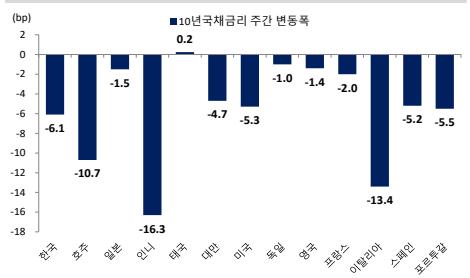
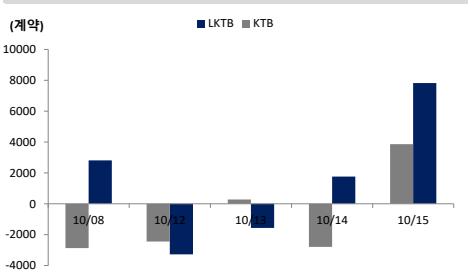


차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



출처 : Bloomberg, 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(10/15)

- 21:30 미국 10월 엠파이어스테이트 제조업(결과:10.5, 이전:17.0)
 21:30 미국 주간 신규 실업수당 청구건수(결과:898k, 이전:845k)
 21:30 미국 9월 수입물가지수 MoM(결과:0.3%, 이전:0.9%)
 21:30 미국 10월 필라델피아 연은 경기전망(결과:32.3, 이전:15.0)
 00:00 미국 DOE 주간 원유재고(결과:-3818k, 이전:501k)

금 일(10/16)

- 08:00 한국 9월 실업률(예상:3.7%, 이전:3.2%)
 18:00 유럽 9월 CPI YoY(F)(예상:-0.3%, 이전:-0.3%)
 21:30 미국 9월 소매판매 MoM(예상:0.8%, 이전:-0.6%)
 22:15 미국 9월 산업생산 MoM(예상:0.6%, 이전:0.4%)
 22:45 미국 Fed 존 월리엄스(뉴욕, 투표권) 총재 연설
 23:00 미국 10월 미시간대 소비자기대(P)(예상:80.5, 이전:80.4)

익 일(10/19)

- 11:00 중국 3분기 GDP QoQ(예상:5.4%, 이전:3.2%)
 11:00 중국 9월 소매판매 YoY(예상:1.9%, 이전:0.5%)
 11:00 중국 9월 산업생산 YoY(예상:5.8%, 이전:5.6%)
 23:00 미국 10월 NAHB 주택시장지수(예상:83, 이전:83)(10/20)
 04:00 미국 Fed 패트릭 하커(필라델피아, 투표권) 총재 연설

KTB Futures

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	(단위 : pt, %, 계약) 미결제약정
NKTB012	111.91	112.00	111.89	111.99	0.12	0.938%	111.95	0.04	2.82	92,049	410,838
NKTB103	111.68	111.68	111.68	111.68	0.04	1.036%	111.83	-0.15	2.82	-	-
10KTB012	132.33	132.69	132.26	132.65	0.47	1.476%	132.55	0.10	8.24	56,250	164,104
10KTB103	132.30	132.30	132.30	132.30	0.00	1.508%	132.30	0.00	8.23	-	11

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : pt, %)				
이동평균선				
	5MA	10MA	20MA	
NKTB012	111.85	111.90	111.88	112.02
10KTB012	132.10	132.31	132.43	133.26
KTB3Y	0.907	0.892	0.894	0.862
KTB5Y	1.200	1.177	1.177	1.135
KTB10Y	1.523	1.501	1.490	1.427

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

NKTB012		10KTB012
2차저항	112.07	132.96
1차저항	112.03	132.81
PIVOT	PIVOT	132.53
1차지지	111.92	132.38
2차지지	111.85	132.10
Demark	High	132.89
	Low	132.46

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	0.871	82.9	82.9	국고 20-3	0.871	23.9	23.9	국고 20-4	1.473	282.4	282.4
국고 19-7	0.803	67.7	67.7	국고 19-7	0.803	19.5	19.5	국고 19-8	1.462	81.6	81.6
국고 20-1	1.112	136.8	136.8	국고 20-6	1.158	39.5	43.4			269.1	269.1
										77.8	77.8

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)				
	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	0.630	0.000	0.000	0.000
통안1년	0.689	-0.007	-0.010	-0.010
국고1년	0.671	-0.009	-0.012	-0.012
국고3년	0.877	-0.024	-0.030	-0.030
국고5년	1.163	-0.031	-0.044	-0.044
국고10년	1.478	-0.035	-0.065	-0.065
국고20년	1.607	-0.012	-0.053	-0.053
국고30년	1.611	-0.014	-0.059	-0.059
국고50년	1.612	-0.012	-0.058	-0.058

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

	CRS		IRS		CRS-IRS
	증간값	전일비	증간값	전일비	
1년	0.070	-0.040	0.690	-0.003	-0.620
2년	0.030	-0.045	0.763	-0.003	-0.733
3년	0.070	-0.035	0.823	-0.020	-0.753
4년	0.095	-0.035	0.880	-0.028	-0.785
5년	0.175	-0.035	0.920	-0.028	-0.745
7년	0.325	-0.035	0.965	-0.033	-0.640
10년	0.440	-0.035	1.025	-0.035	-0.585

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)					
일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	7,824	-3,377	-2,535	-625	-424
1주	7,579	-1,424	-4,232	1,373	-839
2주	17,915	-18,653	-5,153	6,297	-419
4주	78,687	-75,831	-4,191	2,571	418
누적	297,180	-236,648	-41,797	-14,244	-10,844

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	3,866	-1,706	-33	-901	-733
1주	-3,949	6,068	320	-1,907	-724
2주	-2,168	3,709	96	-884	-693
4주	17,767	-12,190	-2,579	-2,631	-2,748
누적	99,203	-75,970	-4,735	-12,991	-5,683

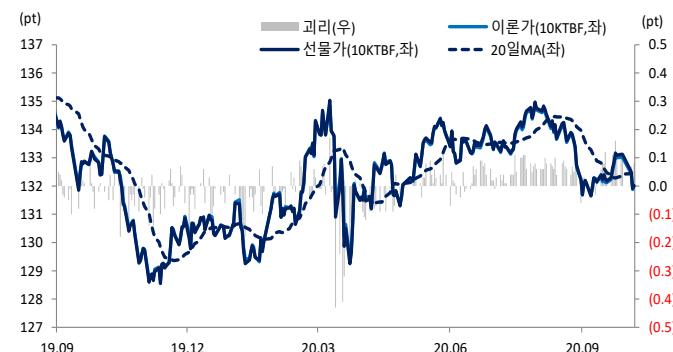
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



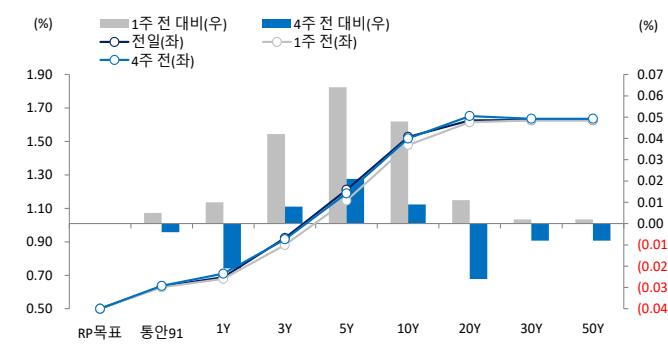
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



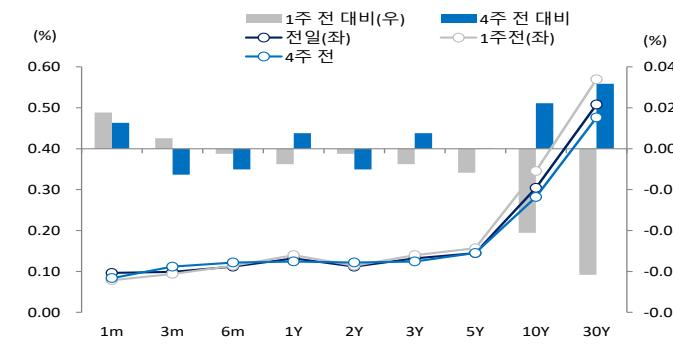
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



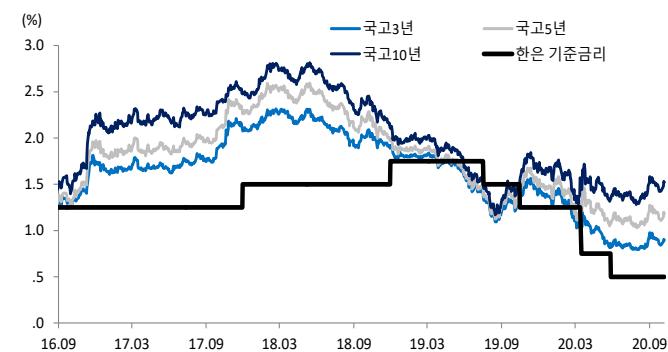
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



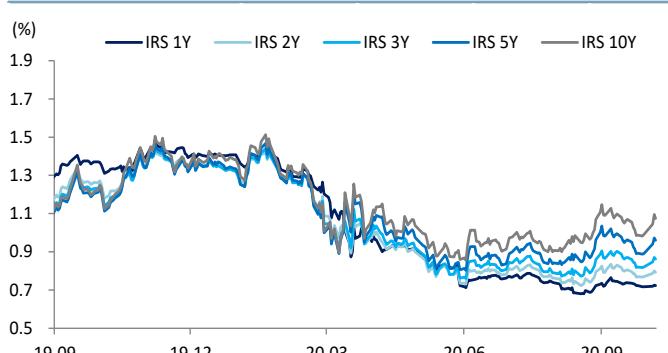
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



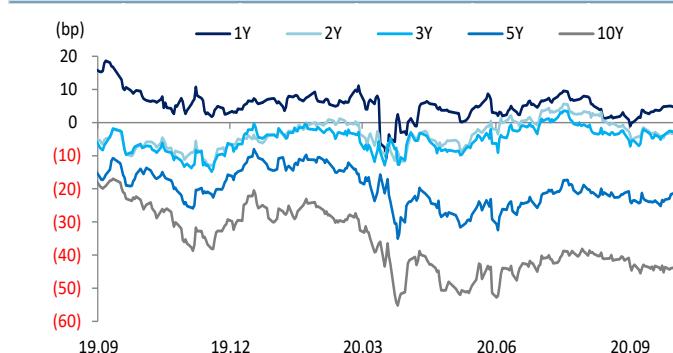
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터