

Fixed Income / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

(단위 : 틱, %, bp, pt, 원)

| 종목 | 전일종가 | 전일대비 | 전주대비 |
|----------|----------|-------|---------|
| NKTB012 | 111.72 | ▼7 | -0.04 |
| 10KTB012 | 131.69 | ▼43 | -0.12 |
| 국고3Y | 0.943 | ▲1.6 | 0.01 |
| 국고10Y | 1.559 | ▲3.2 | 0.01 |
| 국고10Y-3Y | 61.600 | ▼1.6 | 1.60 |
| KOSPI | 2,416.50 | ▲2.71 | ▲149.35 |
| USD/KRW | 1,120.50 | ▼7.80 | ▼14.65 |

◇ 전일 해외시장 동향

(단위 : %, bp, pt, USD)

| 종목 | 전일종가 | 전일대비 | 전주대비 |
|-----------|---------|-------|---------|
| 미국2년 | 0.1527 | ▲0.80 | ▲0.02 |
| 미국5년 | 0.3610 | ▲3.51 | ▼2.34 |
| 미국10년 | 0.8185 | ▲5.56 | ▼5.52 |
| 미국30년 | 1.6000 | ▲7.64 | ▼5.98 |
| 독일10년 | -0.621 | ▲1.60 | ▲0.60 |
| 호주10년 | 0.741 | ▼5.07 | ▼7.45 |
| S&P500 | 3509.44 | ▼1.01 | ▲239.48 |
| USD Index | 92.229 | ▼0.30 | ▼1.81 |
| WTI | 37.14 | ▼1.65 | ▲0.33 |

차트. 주요국 10년 국채금리 주간 등락

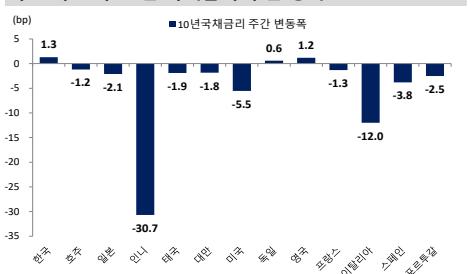
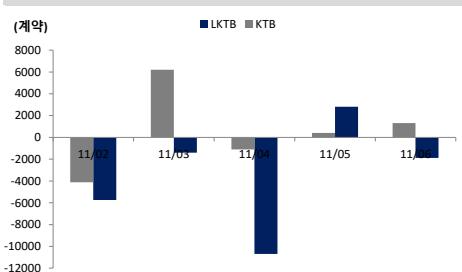


차트. 국채선물 외국인 순매수 동향



출처 : Bloomberg, 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(11/06)

- 22:30 미국 10월 실업률(결과: 6.9%, 이전: 7.9%)
 22:30 미국 10월 비농업부문 고용자수(결과: 638k, 이전: 672k)
 00:00 미국 9월 도매재고 MoM(F)(결과: 0.4%, 잠정: -0.1%)

금 일(11/09)

- 18:30 유럽 11월 센티스 투자기대지수(예상: --, 이전: -8.3) (11/10)
 03:30 미국 Fed 로레타 메스터(클리브랜드, 투표권) 총재 연설

익 일(11/10)

- 10:30 중국 10월 PPI YoY(예상: -1.9%, 이전: -2.1%)
 10:30 중국 10월 CPI YoY(예상: 0.8%, 이전: 1.7%)
 19:00 독일 11월 ZEW 서베이(예상: 45.0, 이전: 56.1)
 20:00 미국 10월 NFIB 소기업 낙관지수(예상: 104.2, 이전: 104.0)

KTB Futures

(단위 : pt, %, 계약)

| 종목 | 시가 | 고가 | 저가 | 종가 | 전일비 | 선물수익률 | 이론가 | 저평가 | M.Dur | 거래량 | 미결제약정 |
|----------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|------|-------|--------|---------|
| NKTB012 | 111.76 | 111.79 | 111.71 | 111.72 | -0.07 | 1.023% | 111.72 | 0.00 | 2.82 | 77,870 | 401,566 |
| NKTB103 | 111.62 | 111.62 | 111.62 | 111.62 | 0.16 | 1.055% | 111.58 | 0.04 | 2.82 | - | - |
| 10KTB012 | 131.92 | 131.99 | 131.66 | 131.69 | -0.43 | 1.564% | 131.66 | 0.03 | 8.23 | 59,275 | 158,354 |
| 10KTB103 | 131.85 | 131.85 | 131.85 | 131.85 | -0.20 | 1.550% | 131.38 | 0.47 | 8.23 | 1 | 16 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : pt, %)

| 이동평균선 | | | | |
|----------|--------|--------|--------|--------|
| | 5MA | 10MA | 20MA | 60MA |
| NKTB012 | 111.68 | 111.75 | 111.81 | 111.91 |
| 10KTB012 | 131.57 | 131.92 | 132.14 | 132.62 |
| KTB3Y | 0.955 | 0.938 | 0.923 | 0.895 |
| KTB5Y | 1.265 | 1.238 | 1.215 | 1.179 |
| KTB10Y | 1.573 | 1.542 | 1.521 | 1.482 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

NKTB012

10KTB012

| | | |
|--------|--------|--------|
| 2차저항 | 111.82 | 132.11 |
| 1차저항 | 111.77 | 131.90 |
| PIVOT | PIVOT | 131.78 |
| 1차지지 | 111.69 | 131.57 |
| 2차지지 | 111.66 | 131.45 |
| Demand | High | 131.84 |
| | Low | 131.51 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헛지비율

(단위 : %, 계약)

| NKTB012 | 수익률 | 3선 헛지비율 10선 헛지비율 | NKTB103 | 수익률 | 3선 헛지비율 10선 헛지비율 | 10KTB009 | 수익률 | 3선 헛지비율 10선 헛지비율 | 10KTB103 | 수익률 | 3선 헛지비율 10선 헛지비율 |
|---------|-------|---------------------|---------|-------|---------------------|----------|-------|---------------------|----------|-------|---------------------|
| 국고 20-3 | 0.944 | 81.1 23.6 | 국고 20-3 | 0.944 | 81.1 23.6 | 국고 20-4 | 1.561 | 280.1 81.4 | 국고 20-4 | 1.561 | 280.1 81.4 |
| 국고 19-7 | 0.866 | 65.9 19.1 | 국고 19-7 | 0.866 | 65.9 19.1 | 국고 19-8 | 1.549 | 267.0 77.6 | 국고 19-8 | 1.549 | 267.0 77.6 |
| 국고 20-1 | 1.211 | 134.9 39.2 | 국고 20-6 | 1.254 | 148.3 43.1 | | | | | | |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

| | 금리 | 전일비 | 1주대비 | 4주대비 |
|-------|-------|-------|-------|--------|
| CD91일 | 0.660 | 0.000 | 0.030 | 0.030 |
| 통안1년 | 0.711 | 0.006 | 0.008 | -0.010 |
| 국고1년 | 0.689 | 0.008 | 0.009 | -0.009 |
| 국고3년 | 0.943 | 0.016 | 0.008 | -0.028 |
| 국고5년 | 1.254 | 0.031 | 0.019 | -0.034 |
| 국고10년 | 1.559 | 0.032 | 0.013 | -0.043 |
| 국고20년 | 1.688 | 0.020 | 0.043 | -0.004 |
| 국고30년 | 1.689 | 0.018 | 0.038 | -0.004 |
| 국고50년 | 1.689 | 0.018 | 0.037 | -0.004 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

(단위 : %, %p)

| | CRS | | IRS | | CRS-IRS |
|-----|-------|-------|-------|-------|---------|
| | 증간값 | 전일비 | 증간값 | 전일비 | Basis |
| 1년 | 0.180 | 0.050 | 0.703 | 0.005 | -0.523 |
| 2년 | 0.195 | 0.050 | 0.780 | 0.015 | -0.585 |
| 3년 | 0.225 | 0.050 | 0.855 | 0.020 | -0.630 |
| 4년 | 0.230 | 0.050 | 0.920 | 0.025 | -0.690 |
| 5년 | 0.260 | 0.055 | 0.968 | 0.033 | -0.708 |
| 7년 | 0.475 | 0.055 | 1.025 | 0.038 | -0.550 |
| 10년 | 0.655 | 0.055 | 1.098 | 0.045 | -0.443 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인 | 금융투자 | 투신 | 은행 | 보험 |
|----|---------|----------|---------|---------|---------|
| 당일 | -1,889 | 2,311 | -31 | -557 | 45 |
| 1주 | -16,898 | 16,836 | 2,284 | -2,186 | -282 |
| 2주 | -24,038 | 27,722 | 323 | -3,353 | -957 |
| 4주 | -21,053 | 24,704 | -1,795 | 386 | -1,127 |
| 누적 | 271,368 | -213,834 | -38,892 | -15,066 | -11,117 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인 | 금융투자 | 투신 | 은행 | 보험 |
|----|--------|---------|--------|---------|--------|
| 당일 | 1,321 | -1,190 | 294 | -502 | 266 |
| 1주 | 2,701 | -3,424 | 949 | -454 | 793 |
| 2주 | -2,807 | 5,627 | -938 | -2,270 | 837 |
| 4주 | -3,144 | 6,075 | -1,898 | -1,566 | 867 |
| 누적 | 97,142 | -72,672 | -7,139 | -13,375 | -3,723 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



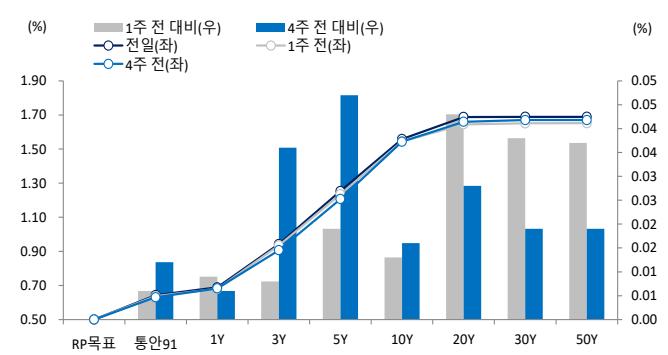
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



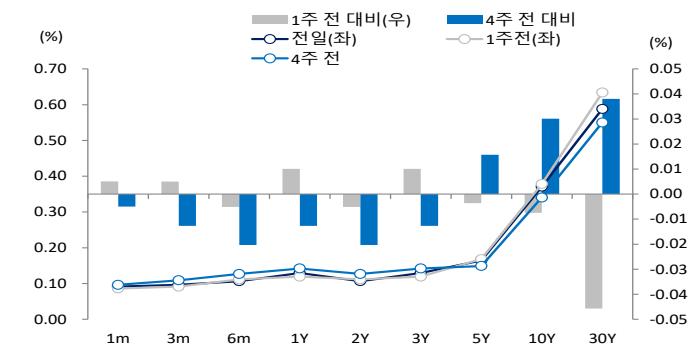
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 국채 수익률 곡선



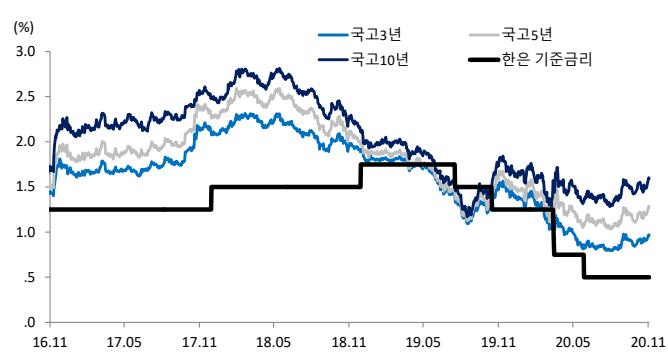
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 국채 수익률 곡선



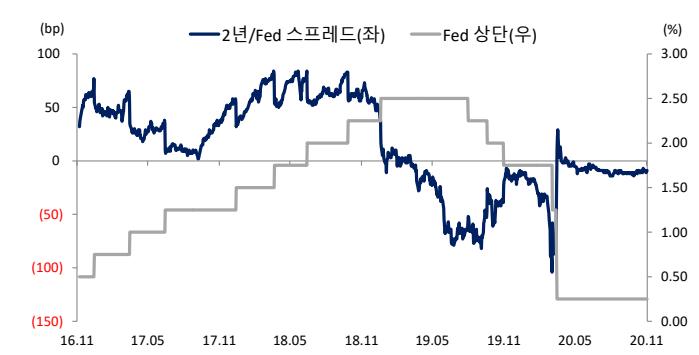
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 한국 기준금리 및 국고채 금리 추이



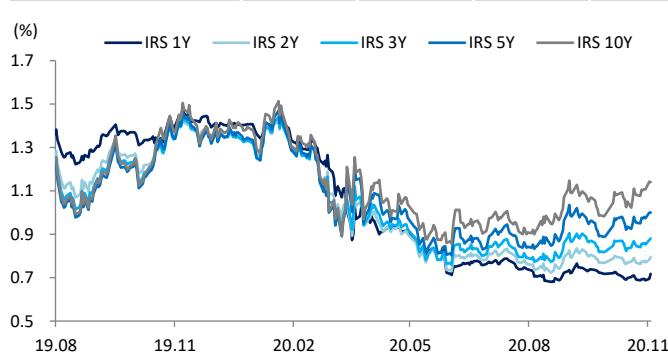
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 미국 정책금리 상단 및 2년물 스프레드



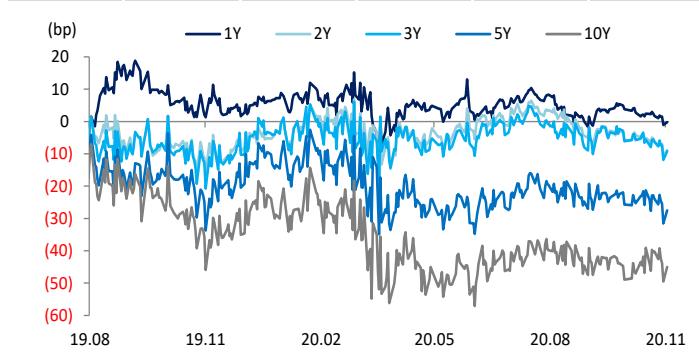
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터