

KTB/USD Data(2018.12.28)

KTB Futures

(단위 : pt, %, 계약)

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	미결제약정
NKTB903	109.18	109.27	109.17	109.24	-0.01	1.821%	109.16	0.08	2.81	45,761	324,354
NKTB906	109.20	109.20	109.20	109.20	0.00	1.834%	109.20	0.00	2.81	-	-
10KTB903	127.21	127.59	127.12	127.59	0.04	1.950%	127.47	0.12	8.18	61,722	97,633
10KTB906	127.52	127.52	127.52	127.52	0.00	1.957%	127.56	-0.04	8.18	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : %, pt)

	이동평균선			
	5MA	10MA	20MA	60MA
NKTB903	109.23	109.24	109.15	108.78
10KTB903	127.40	127.23	126.90	125.06
KTBY	1.820	1.805	1.832	1.929
KTBY	1.876	1.876	1.902	2.040
KTBY	1.961	1.982	2.029	2.202

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

	NKTB903	10KTB903
2차저항	109.33	127.90
1차저항	109.28	127.75
PIVOT	PIVOT	127.43
1차지지	109.18	127.28
2차지지	109.13	126.96
Demark	High	127.83
	Low	127.36

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헷지비율

(단위 : %, 계약)

NKTB903	수익률	헷지비율	NKTB906	수익률	헷지비율	10KTB903	수익률	헷지비율	10KTB906	수익률	헷지비율
국고 18-3	1.847	78.36	국고 18-3	1.847	78.39	국고 18-4	1.960	84.94	국고 18-4	1.960	85.00
국고 17-6	1.836	62.25	국고 18-9	1.810	93.75	국고 17-7	1.961	79.81	국고 18-10	1.941	86.66
국고 18-6	1.875	147.64	국고 18-6	1.875	147.70						

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91물	1.920	0.000	0.020	0.220
통안1년	1.839	0.001	0.009	-0.059
국고1년	1.747	0.002	0.004	-0.094
국고3년	1.810	0.003	0.027	-0.110
국고5년	1.874	0.004	0.045	-0.131
국고10년	1.943	-0.005	0.011	-0.212
국고20년	1.952	-0.006	0.032	-0.166
국고30년	1.928	0.003	0.051	-0.122
국고50년	1.925	0.004	0.048	-0.052

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

(단위 : %, %p)

	CRS		IRS		CRS-IRS
	중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
1년	1.225	0.035	1.873	0.010	-0.648
2년	1.145	0.015	1.808	0.003	-0.663
3년	1.140	0.010	1.778	0.003	-0.638
4년	1.130	0.010	1.770	0.003	-0.640
5년	1.110	0.010	1.765	0.000	-0.655
7년	1.220	0.010	1.773	0.003	-0.553
10년	1.410	0.010	1.815	0.003	-0.405

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	개인
12월 27일	-1,032	3,267	159	-1,733	-106
12월 26일	-1,160	2,349	31	-260	-70
12월 24일	-872	1,632	-639	-626	6
12월 21일	-12,012	6,595	286	1,766	1,044
12월 20일	-5,738	4,723	-227	524	109
1주	-20,814	18,566	-390	-329	983
2주	-22,147	18,284	-5,188	5,163	699
4주	-24,031	-12,884	-2,040	36,069	509
누적	201,052	-177,854	-13,710	11,789	2,836

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	개인
12월 27일	575	35	-199	-46	6
12월 26일	453	1,208	94	-678	-77
12월 24일	-544	1,177	-461	-429	124
12월 21일	-1,491	2,286	-37	-1,141	46
12월 20일	-2,303	1,993	-281	664	196
1주	-3,310	6,699	-884	-1,630	295
2주	-4,023	9,328	-193	-4,127	354
4주	-14,670	14,384	443	0	2,167
누적	58,581	-37,195	-5,384	-11,817	3,285

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD901	1120.2	-5.4	1121.7	1122.6	1118.6	4.0	141424	-5233	556134	831
USD902	1119.0	-5.1	1120.9	1121.3	1117.4	3.9	1671	712	31321	135
USD SPOT	1120.0	-5.4	1123.0	1123.1	1119.3	3.8	3820	557	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	16,355	22,238	-5,883	17,583	39,589
은행	1,000	2,000	-1,000	-16,050	-30,803
투신	1,674	1,099	575	5,157	7,534
보험	480	50	430	5,241	5,872
기타법인	8,235	2,709	5,526	4,147	25,135
개인	30,467	21,351	9,116	6,153	16,849
외국인	82,292	90,636	-8,344	-20,832	-63,698

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2028.44	0.43
국고채3Y	1.810	0.003
국고채10Y	1.943	-0.005

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	39.336	-0.645

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	2,420	388	271
KOSDAQ	-1,177	-752	2,073
국고채	-325	-931	7,461
통안채	54	6,325	52,959

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	1.750	0.000	1M	2.52238	0.01675
Call	1.950	0.030	3M	2.80300	-0.01044
CD	1.920	0.000	6M	2.88300	-0.01075
통안1년	1.839	0.001	12M	3.03238	-0.01550

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

*Boxing Date로 휴장

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	23,138.82	260.37	1.14	-0.79
S&P	2,488.83	21.13	0.86	-0.72
나스닥	6,579.49	25.14	0.38	-0.86
FTSE 100	6,584.68	-101.31	-1.52	-1.74
DAX 30	10,381.51	-252.31	-2.37	-3.63
Nikkei 225	20,077.62	750.56	3.88	-4.34
Shanghai	2,483.09	-15.21	-0.61	-2.10
항셱 H	9,991.06	-71.88	-0.71	-2.34
미국채 2년	2.57	-0.05	-1.85	-3.90
미국채 10년	2.78	-0.03	-1.15	-1.10
WTI	45.66	-0.56	-1.21	-5.21
Gold	1,277.50	7.69	0.61	1.17

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	-0.95	0.25
3M	-3.50	0.25
6M	-8.00	0.40
12M	-18.20	0.40

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	1.225	0.035
2Y	1.145	0.015
3Y	1.140	0.010
4Y	1.130	0.010
5Y	1.110	0.010

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화

아시아 통화

기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	96.550	-0.500	0.28	USD/KRW	1,120.25	-5.10	-0.66	USD/RUB	69.5918	0.8912	1.8244
EUR/USD	1.1439	0.0086	-0.06	USD/CNY	6.8663	-0.0191	-0.27	USD/BRL	3.8759	-0.0522	0.8246
USD/JPY	111.06	-0.31	-0.20	USD/HKD	7.8295	0.0010	-0.01	USD/ZAR	14.4737	-0.0963	0.4114
GBP/USD	1.2654	0.0021	-0.02	USD/SGD	1.3708	-0.0013	0.01	USD/MXN	19.6683	-0.2372	-1.1191
USD/CHF	0.9873	-0.0084	-0.06	USD/TWD	30.793	-0.020	-0.14	USD/PLN	3.7527	-0.0232	0.2110
AUD/USD	0.7033	-0.0033	-1.06	USD/INR	70.35	0.28	0.93	USD/TRY	5.2837	0.0055	0.4029
NZD/USD	0.6698	-0.0034	-1.15	USD/IDR	14,561	-21	0.61	USD/SEK	9.0041	-0.0996	0.3198
USD/CAD	1.3617	0.0043	0.80	USD/THB	32.557	-0.020	-0.39	USD/NOK	8.7640	-0.0027	0.8875

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(12/27)	금 일(12/28)	익 일(01/02)
14:00 일본 11월 주택착공건수 YoY(결과:-0.6%, 이전:0.3%)	08:00 한국 11월 광공업생산 MoM(예상:-0.2%, 이전:1.0%)	(31일)
22:30 미국 신규 실업수당 청구건수(결과:216k, 이전:214k)	08:30 일본 12월 도쿄 CPI YoY(예상:0.5%, 이전:0.8%)	08:00 한국 12월 소비자물가지수 YoY(예상:1.7%, 이전:2.0%)
23:00 미국 10월 주택가격지수 MoM(결과:0.2%, 이전:0.2%)	08:50 일본 11월 광공업생산 MoM(P)(예상:-1.5%, 이전:2.9%)	10:00 중국 12월 제조업 PMI(예상:50.0, 이전:50.0)
(28일)	22:30 미국 11월 도매재고 MoM(P)(예상:-, 이전:0.8%)	10:00 중국 12월 비제조업 PMI(예상:53.1, 결과:53.4)
00:00 미국 12월 컨퍼런스보드 소비자(결과:128.1, 이전:135.7)	23:45 미국 12월 시카고 구매자협회(예상:61.0, 이전:66.4)	(1일)
06:00 한국 1월 기업경기실사 제조업(결과:71, 이전:71)	(29일)	00:30 미국 12월 달러스 연준제조업활동(예상:17.0, 이전:17.6)
	01:00 미국 원유재고(예상:-, 이전:-497k)	09:00 한국 12월 수출 YoY(예상:2.5%, 이전:4.5%)

*주 : 예상 대비 호조(상승), 예상치 부합, 예상 대비 부진(하락), Bloomberg 컨센서스 기준