

## KTB Futures

(단위 : pt, % 계약)

| 종목       | 시가     | 고가     | 저가     | 종가     | 전일비  | 선물수익률  | 이론가    | 저평가   | M.Dur | 거래량     | 미결제약정   |
|----------|--------|--------|--------|--------|------|--------|--------|-------|-------|---------|---------|
| NKTB006  | 110.85 | 111.07 | 110.60 | 110.96 | 0.41 | 1.265% | 111.03 | -0.07 | 2.82  | 134,421 | 281,553 |
| NKTB009  | 110.70 | 110.70 | 110.70 | 110.70 | 0.00 | 1.349% | 110.91 | -0.21 | 2.81  | -       | -       |
| 10KTB006 | 130.70 | 130.75 | 129.88 | 130.50 | 0.63 | 1.675% | 130.64 | -0.14 | 8.21  | 51,129  | 105,828 |
| 10KTB009 | 0.00   | 0.00   | 0.00   | 131.40 | 0.00 | 1.591% | 130.44 | 0.96  | 8.22  | -       | -       |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 이동평균

(단위 : %, pt)

|       | 이동평균선  |        |        |        |
|-------|--------|--------|--------|--------|
|       | 5MA    | 10MA   | 20MA   | 60MA   |
| NKTB  | 111.12 | 111.26 | 111.32 | 110.85 |
| 10KTB | 131.39 | 132.45 | 133.11 | 131.54 |
| KT3Y  | 1.096  | 1.090  | 1.102  | 1.261  |
| KT5Y  | 1.308  | 1.255  | 1.230  | 1.375  |
| KT10Y | 1.547  | 1.470  | 1.423  | 1.562  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Basket 수익률과 헷지비율

(단위 : %, 계약)

| NKTB003 | 수익률   | 헷지비율   | NKTB006 | 수익률   | 헷지비율   | 10KTB003 | 수익률   | 헷지비율  | 10KTB006 | 수익률   | 헷지비율  |
|---------|-------|--------|---------|-------|--------|----------|-------|-------|----------|-------|-------|
| 국고 19-7 | 1.114 | 281.63 | 국고 19-7 | 1.114 | 282.44 | 국고 19-4  | 1.666 | 35.89 | 국고 19-4  | 1.666 | 35.59 |
| 국고 19-3 | 1.123 | 271.29 | 국고 19-3 | 1.123 | 272.06 | 국고 19-8  | 1.622 | 39.85 | 국고 19-8  | 1.622 | 39.53 |
| 국고 19-5 | 1.445 | 69.73  | 국고 20-1 | 1.399 | 85.63  |          |       |       |          |       |       |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

|       | 금리    | 전일비    | 1주대비   | 4주대비   |
|-------|-------|--------|--------|--------|
| CD91일 | 1.020 | 0.000  | -0.370 | -0.390 |
| 통안1년  | 1.038 | -0.014 | -0.068 | -0.105 |
| 국고1년  | 1.019 | -0.047 | -0.054 | -0.094 |
| 국고3년  | 1.107 | -0.086 | -0.042 | 0.003  |
| 국고5년  | 1.388 | -0.046 | 0.074  | 0.208  |
| 국고10년 | 1.611 | -0.046 | 0.041  | 0.278  |
| 국고20년 | 1.663 | -0.007 | 0.087  | 0.279  |
| 국고30년 | 1.645 | -0.009 | 0.054  | 0.248  |
| 국고50년 | 1.644 | -0.008 | 0.053  | 0.247  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자     | 외국인     | 금융투자     | 투신      | 은행     | 보험     |
|--------|---------|----------|---------|--------|--------|
| 3월 20일 | -7,741  | 9,014    | -1,210  | -1,036 | 326    |
| 3월 19일 | -20,827 | 8,509    | 1,599   | 1,891  | 2,197  |
| 3월 18일 | 634     | -7,908   | -845    | -1,465 | -227   |
| 3월 17일 | -4,054  | 1,388    | 504     | -924   | 282    |
| 3월 16일 | -15,053 | 11,989   | -4,018  | 7,142  | -489   |
| 1주     | -47,041 | 22,992   | -3,970  | 5,608  | 2,089  |
| 2주     | -78,420 | 51,268   | 7,710   | -7,249 | 4,032  |
| 4주     | -60,481 | 24,968   | 5,521   | 442    | 2,671  |
| 누적     | 182,620 | -164,228 | -23,605 | -3,733 | -2,597 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 기술적 지표

|        | NKTB006 | 10KTB006 |
|--------|---------|----------|
| 2차저항   | 111.35  | 131.25   |
| 1차저항   | 111.15  | 130.87   |
| PIVOT  | PIVOT   | 110.88   |
| 1차지지   | 110.68  | 130.00   |
| 2차지지   | 110.41  | 129.51   |
| Demark | High    | 111.25   |
|        | Low     | 110.78   |
|        |         | 129.76   |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS/IRS

(단위 : %, %p)

|     | CRS    |       | IRS   |        | CRS-IRS |
|-----|--------|-------|-------|--------|---------|
|     | 중간값    | 전일비   | 중간값   | 전일비    | Basis   |
| 1년  | -0.515 | 0.935 | 0.970 | -0.060 | -1.485  |
| 2년  | -0.265 | 0.480 | 1.030 | -0.060 | -1.295  |
| 3년  | -0.215 | 0.350 | 1.060 | -0.063 | -1.275  |
| 4년  | -0.140 | 0.335 | 1.118 | -0.065 | -1.258  |
| 5년  | -0.100 | 0.285 | 1.150 | -0.065 | -1.250  |
| 7년  | 0.060  | 0.285 | 1.148 | -0.070 | -1.088  |
| 10년 | 0.278  | 0.263 | 1.185 | -0.070 | -0.908  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자     | 외국인     | 금융투자    | 투신     | 은행     | 보험     |
|--------|---------|---------|--------|--------|--------|
| 3월 20일 | -4,059  | 3,850   | 382    | 114    | -460   |
| 3월 19일 | -8,161  | 4,070   | 175    | 1,322  | 1,176  |
| 3월 18일 | -4,473  | 6,553   | -1,107 | -1,434 | 124    |
| 3월 17일 | -5,377  | 5,467   | -616   | -62    | 393    |
| 3월 16일 | -789    | 1,657   | 538    | -1,059 | -241   |
| 1주     | -22,859 | 21,597  | -628   | -1,119 | 992    |
| 2주     | -35,009 | 30,286  | 559    | -7,274 | 5,047  |
| 4주     | -7,494  | 9,933   | -816   | -8,068 | 4,043  |
| 누적     | 36,332  | -27,873 | -64    | 2,688  | -3,677 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

본 자료는 투자자의 이해를 돕기 위해 참고가 되는 정보 제공을 목적으로 작성되었습니다. 당사 고객들에게 배포되는 자료로서 본 조사자료의 내용은 당사의 리서치센터에서 신뢰할 수 있는 자료와 정보를 이용하여 작성한 것이나, 당사는 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없습니다. 투자자는 자신의 판단과 책임하에 투자를 하여야 하며, 본 자료는 투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙자료로 사용될 수 없습니다. 그리고 파생상품은 높은 가격변동성으로 인해 단기간에 투자원금의 전부 또는 상당부분을 손실할 수 있습니다. 본 자료는 당사 홈페이지(www.futures.co.kr)에서도 이용하실 수 있습니다.