

\* 당사 사정으로 KTB Futures는 데이터 파일로 시황을 대체합니다. 감사합니다.

## KTB Futures

(단위 : pt, %, 계약)

| 종목       | 시가     | 고가     | 저가     | 종가     | 전일비   | 선물수익률  | 이론가    | 저평가   | M.Dur | 거래량    | 미결제약정   |
|----------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|-------|-------|--------|---------|
| NKTB006  | 111.73 | 111.79 | 111.72 | 111.78 | 0.03  | 1.004% | 111.73 | 0.05  | 2.82  | 46,705 | 332,855 |
| NKTB009  | 111.72 | 111.72 | 111.72 | 111.72 | 0.15  | 1.023% | 111.75 | -0.03 | 2.82  | -      | -       |
| 10KTB006 | 132.12 | 132.34 | 132.10 | 132.20 | -0.09 | 1.517% | 132.16 | 0.04  | 8.23  | 30,865 | 124,012 |
| 10KTB009 | 132.16 | 132.16 | 132.16 | 132.16 | 0.26  | 1.521% | 132.04 | 0.12  | 8.23  | -      | 3       |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 이동평균

(단위 : %, pt)

|        | 이동평균선  |        |        |        |
|--------|--------|--------|--------|--------|
|        | 5MA    | 10MA   | 20MA   | 60MA   |
| NKTB   | 111.64 | 111.59 | 111.57 | 111.29 |
| 10KTB  | 131.89 | 132.03 | 132.14 | 132.19 |
| KTB3Y  | 1.000  | 1.015  | 1.014  | 1.104  |
| KTB5Y  | 1.252  | 1.255  | 1.250  | 1.283  |
| KTB10Y | 1.532  | 1.519  | 1.502  | 1.503  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 기술적 지표

## NKTB006

## 10KTB006

|        |        |        |        |
|--------|--------|--------|--------|
| PIVOT  | 2차저항   | 111.83 | 132.45 |
|        | 1차저항   | 111.81 | 132.33 |
| Demark | 1차지지   | 111.74 | 132.09 |
|        | 2차지지   | 111.69 | 131.97 |
| High   | 111.82 | 132.39 |        |
|        | Low    | 111.75 | 132.15 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Basket 수익률과 헛지비율

(단위 : %, 계약)

| NKTB003 | 수익률   | 헷지비율   | NKTB006 | 수익률   | 헷지비율   | 10KTB003 | 수익률   | 헷지비율  | 10KTB006 | 수익률   | 헷지비율  |
|---------|-------|--------|---------|-------|--------|----------|-------|-------|----------|-------|-------|
| 국고 19-7 | 0.958 | 279.46 | 국고 19-7 | 0.958 | 279.56 | 국고 19-4  | 1.517 | 34.42 | 국고 19-4  | 1.517 | 34.44 |
| 국고 19-3 | 0.900 | 270.30 | 국고 19-3 | 0.900 | 270.39 | 국고 19-8  | 1.508 | 38.35 | 국고 19-8  | 1.508 | 38.36 |
| 국고 19-5 | 1.190 | 65.59  | 국고 20-1 | 1.224 | 81.09  |          |       |       |          |       |       |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

|       | 금리    | 전일비    | 1주대비   | 4주대비   |
|-------|-------|--------|--------|--------|
| CD91일 | 1.100 | 0.000  | 0.000  | 0.000  |
| 통안1년  | 0.796 | -0.005 | -0.021 | -0.064 |
| 국고1년  | 0.845 | -0.011 | -0.027 | -0.046 |
| 국고3년  | 0.960 | -0.015 | -0.046 | -0.064 |
| 국고5년  | 1.224 | 0.009  | -0.022 | -0.040 |
| 국고10년 | 1.508 | 0.009  | -0.010 | -0.003 |
| 국고20년 | 1.632 | 0.010  | -0.002 | 0.034  |
| 국고30년 | 1.662 | 0.017  | 0.006  | 0.054  |
| 국고50년 | 1.663 | 0.017  | 0.007  | 0.056  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자     | 외국인     | 금융투자     | 투신      | 은행      | 보험     |
|--------|---------|----------|---------|---------|--------|
| 5월 6일  | 3,156   | 543      | -313    | -1,037  | -403   |
| 5월 4일  | 239     | -3,098   | 2,025   | 1,590   | -120   |
| 4월 29일 | 3,220   | 1,325    | -255    | -215    | -367   |
| 4월 28일 | 851     | -4,077   | 168     | 3,125   | -174   |
| 4월 27일 | 684     | 924      | 2,136   | -5,214  | 108    |
| 1주     | 8,150   | -4,383   | 3,761   | -1,751  | -956   |
| 2주     | 15,366  | -17,450  | 558     | 8,000   | -1,226 |
| 4주     | 26,151  | -37,617  | 1,277   | 11,877  | -2,311 |
| 누적     | 219,214 | -191,923 | -30,642 | -12,322 | -6,674 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS/IRS

(단위 : %, %p)

|     | CRS    |       | IRS   |        | CRS-IRS |
|-----|--------|-------|-------|--------|---------|
|     | 증간값    | 전일비   | 증간값   | 전일비    | Basis   |
| 1년  | -0.325 | 0.040 | 0.873 | -0.013 | -1.198  |
| 2년  | -0.310 | 0.050 | 0.855 | -0.013 | -1.165  |
| 3년  | -0.303 | 0.048 | 0.875 | -0.013 | -1.178  |
| 4년  | -0.280 | 0.050 | 0.905 | -0.010 | -1.185  |
| 5년  | -0.250 | 0.055 | 0.925 | -0.010 | -1.175  |
| 7년  | -0.125 | 0.060 | 0.943 | -0.005 | -1.068  |
| 10년 | 0.055  | 0.060 | 0.993 | -0.005 | -0.938  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자     | 외국인    | 금융투자    | 투신    | 은행      | 보험     |
|--------|--------|---------|-------|---------|--------|
| 5월 6일  | 4,270  | -3,814  | 246   | -98     | -60    |
| 5월 4일  | 256    | -1,739  | 613   | 868     | 53     |
| 4월 29일 | 1,817  | -373    | -54   | -367    | -326   |
| 4월 28일 | 3,911  | -3,665  | 772   | -716    | -29    |
| 4월 27일 | 692    | -1,205  | 337   | -435    | 364    |
| 1주     | 10,946 | -10,796 | 1,914 | -748    | 2      |
| 2주     | 14,792 | -8,552  | 1,908 | -6,330  | 501    |
| 4주     | 16,028 | -8,148  | 1,635 | -9,534  | -254   |
| 누적     | 64,637 | -43,787 | 1,206 | -11,691 | -5,140 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

본 자료는 투자의 이해를 돋기 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. 투자는 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](http://www.futures.co.kr))에서도 이용하실 수 있습니다.