

KTB Futures

(단위 : pt, % 계약)

| 종목 | 시가 | 고가 | 저가 | 종가 | 전일비 | 선물수익률 | 이론가 | 저평가 | M.Dur | 거래량 | 미결제약정 |
|----------|--------|--------|--------|--------|------|--------|--------|-------|-------|--------|---------|
| NKTB006 | 111.88 | 111.94 | 111.85 | 111.94 | 0.10 | 0.953% | 111.88 | 0.06 | 2.82 | 61,126 | 349,685 |
| NKTB009 | 111.78 | 111.78 | 111.78 | 111.78 | 0.05 | 1.004% | 111.91 | -0.13 | 2.82 | - | - |
| 10KTB006 | 132.85 | 133.17 | 132.74 | 133.13 | 0.48 | 1.432% | 133.13 | 0.00 | 8.24 | 40,192 | 129,254 |
| 10KTB009 | 132.52 | 132.52 | 132.52 | 132.52 | 0.45 | 1.488% | 133.03 | -0.51 | 8.24 | - | 3 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : %, pt)

| | 이동평균선 | | | |
|-------|--------|--------|--------|--------|
| | 5MA | 10MA | 20MA | 60MA |
| NKTB | 111.79 | 111.65 | 111.62 | 111.33 |
| 10KTB | 132.46 | 132.04 | 132.28 | 132.25 |
| KT3Y | 0.960 | 0.996 | 1.001 | 1.092 |
| KT5Y | 1.212 | 1.247 | 1.238 | 1.276 |
| KT10Y | 1.486 | 1.519 | 1.492 | 1.498 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헷지비율

(단위 : %, 계약)

| NKTB003 | 수익률 | 헷지비율 | NKTB006 | 수익률 | 헷지비율 | 10KTB003 | 수익률 | 헷지비율 | 10KTB006 | 수익률 | 헷지비율 |
|---------|-------|--------|---------|-------|--------|----------|-------|-------|----------|-------|-------|
| 국고 19-7 | 0.912 | 279.77 | 국고 19-7 | 0.912 | 280.26 | 국고 19-4 | 1.430 | 34.17 | 국고 19-4 | 1.430 | 34.36 |
| 국고 19-3 | 0.860 | 270.36 | 국고 19-3 | 0.860 | 270.83 | 국고 19-8 | 1.425 | 38.09 | 국고 19-8 | 1.425 | 38.30 |
| 국고 19-5 | 1.134 | 65.15 | 국고 20-1 | 1.164 | 80.84 | | | | | | |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

| | 금리 | 전일비 | 1주대비 | 4주대비 |
|-------|-------|--------|--------|--------|
| CD91일 | 1.080 | 0.000 | -0.020 | -0.020 |
| 통안1년 | 0.762 | -0.016 | -0.055 | -0.077 |
| 국고1년 | 0.819 | -0.015 | -0.053 | -0.037 |
| 국고3년 | 0.914 | -0.032 | -0.092 | -0.056 |
| 국고5년 | 1.166 | -0.043 | -0.080 | -0.028 |
| 국고10년 | 1.426 | -0.054 | -0.092 | -0.018 |
| 국고20년 | 1.540 | -0.058 | -0.094 | 0.006 |
| 국고30년 | 1.558 | -0.062 | -0.098 | 0.021 |
| 국고50년 | 1.558 | -0.063 | -0.098 | 0.021 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인 | 금융투자 | 투신 | 은행 | 보험 |
|--------|---------|----------|---------|---------|--------|
| 5월 8일 | 7,167 | -2,182 | -1,492 | -2,009 | -332 |
| 5월 7일 | 6,786 | -2,826 | 349 | -2,824 | -404 |
| 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 |
| 1주 | 20,568 | -6,238 | 314 | -4,495 | -1,626 |
| 2주 | 30,688 | -16,124 | -1,473 | -1,614 | -2,102 |
| 4주 | 44,253 | -40,535 | 1,284 | 333 | -2,632 |
| 누적 | 233,167 | -196,931 | -31,785 | -17,155 | -7,410 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

| | NKTB006 | 10KTB006 |
|--------|---------|----------|
| 2차저항 | 112.00 | 133.44 |
| 1차저항 | 111.97 | 133.29 |
| PIVOT | PIVOT | 111.91 |
| 1차지지 | 111.88 | 132.86 |
| 2차지지 | 111.82 | 132.58 |
| Demark | High | 111.99 |
| | Low | 111.90 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

(단위 : %, %p)

| | CRS | | IRS | | CRS-IRS |
|-----|--------|-------|-------|--------|---------|
| | 중간값 | 전일비 | 중간값 | 전일비 | Basis |
| 1년 | -0.205 | 0.110 | 0.820 | -0.018 | -1.025 |
| 2년 | -0.255 | 0.048 | 0.795 | -0.025 | -1.050 |
| 3년 | -0.245 | 0.045 | 0.818 | -0.030 | -1.063 |
| 4년 | -0.230 | 0.040 | 0.843 | -0.033 | -1.073 |
| 5년 | -0.200 | 0.040 | 0.853 | -0.040 | -1.053 |
| 7년 | -0.075 | 0.040 | 0.870 | -0.040 | -0.945 |
| 10년 | 0.105 | 0.040 | 0.920 | -0.040 | -0.815 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인 | 금융투자 | 투신 | 은행 | 보험 |
|--------|--------|---------|-------|--------|--------|
| 5월 8일 | -35 | -2,413 | 179 | 2,594 | -267 |
| 5월 7일 | 4,372 | -3,240 | -155 | -548 | -164 |
| 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 |
| 1주 | 10,680 | -11,579 | 829 | 2,449 | -764 |
| 2주 | 20,331 | -17,344 | 1,498 | -2,166 | -359 |
| 4주 | 22,455 | -14,934 | 1,622 | -6,492 | -899 |
| 누적 | 68,974 | -49,440 | 1,230 | -9,645 | -5,571 |

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.