

\* 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	112.11	112.11	112.02	112.08	-0.01	0.909%	112.02	0.06	2.82	80,142	375,120
NKTB009	112.13	112.13	112.13	112.13	0.22	0.893%	112.05	0.08	2.82	-	-
10KTB006	133.61	133.81	133.39	133.64	0.12	1.386%	133.61	0.03	8.25	40,749	134,748
10KTB009	133.50	133.50	133.50	133.50	0.00	1.399%	133.51	-0.01	8.25	-	2

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 이동평균

(단위 : %, pt)

	이동평균선			
	5MA	10MA	20MA	60MA
NKTB	111.99	111.85	111.71	111.42
10KTB	133.21	132.68	132.50	132.39
KTB3Y	0.890	0.937	0.976	1.064
KTB5Y	1.145	1.191	1.217	1.257
KTB10Y	1.417	1.465	1.477	1.484

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Basket 수익률과 헛지비율

(단위 : %, 계약)

NKTB003	수익률	3선 헛지비율	NKTB006	수익률	3선 헛지비율	10KTB003	수익률	3선 헛지비율	10KTB006	수익률	3선 헛지비율
		10선 헛지비율			10선 헛지비율			10선 헛지비율			10선 헛지비율
국고 19-7	0.869	80.66	국고 19-7	0.869	80.61	국고 19-4	1.384	78.84	국고 19-4	1.384	78.93
		23.18			23.18			78.78			78.78
국고 19-3	0.821	65.44	국고 19-3	0.821	65.40	국고 19-8	1.382	81.03	국고 19-8	1.382	81.13
		18.82			18.82			80.68			80.68
국고 19-5	1.086	133.99	국고 20-1	1.119	149.36						
		38.49			42.86						

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	1.050	0.000	-0.030	-0.050
통안1년	0.735	0.003	-0.043	-0.120
국고1년	0.786	0.006	-0.048	-0.082
국고3년	0.869	0.013	-0.077	-0.113
국고5년	1.122	0.011	-0.087	-0.062
국고10년	1.381	-0.011	-0.099	-0.030
국고20년	1.489	-0.010	-0.109	-0.044
국고30년	1.499	-0.012	-0.121	-0.048
국고50년	1.498	-0.012	-0.123	-0.048

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	2,521	-2,504	-347	-299	220
1주	20,769	-6,749	-3,609	-5,243	-2,015
2주	35,021	-14,882	-1,635	-4,604	-3,483
4주	52,154	-38,866	-2,583	-2,127	-3,589
누적	246,769	-201,498	-33,902	-20,389	-9,093

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS/IRS

(단위 : %, %p)

	CRS	IRS	CRS-IRS
	중간값	전일비	Basis
1년	-0.010	-0.025	0.815
2년	-0.045	0.020	0.785
3년	-0.065	0.020	0.793
4년	-0.050	0.015	0.813
5년	-0.010	0.020	0.825
7년	0.110	0.015	0.828
10년	0.285	0.015	0.878

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	1,302	-644	-458	362	-216
1주	3,875	-3,589	-1,121	1,644	-619
2주	18,501	-16,420	301	783	-1,145
4주	27,046	-17,962	1,173	-7,165	-283
누적	72,884	-50,616	-70	-10,595	-5,923

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. 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](http://www.futures.co.kr))에서도 이용하실 수 있습니다.