

## KTB Futures

(단위 : pt, %, 계약)

| 종목       | 시가     | 고가     | 저가     | 종가     | 전일비   | 선물수익률  | 이론가    | 저평가   | M.Dur | 거래량     | 미결제약정   |
|----------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|-------|-------|---------|---------|
| NKTB009  | 111.91 | 111.93 | 111.80 | 111.86 | -0.06 | 0.979% | 111.88 | -0.02 | 2.82  | 110,492 | 344,097 |
| NKTB012  | 111.84 | 111.84 | 111.84 | 111.84 | 0.00  | 0.985% | 111.78 | 0.06  | 2.82  | -       | -       |
| 10KTB009 | 133.15 | 133.38 | 132.81 | 133.28 | 0.13  | 1.419% | 133.21 | 0.07  | 8.24  | 58,689  | 150,885 |
| 10KTB012 | 132.96 | 132.96 | 132.96 | 132.96 | 0.00  | 1.448% | 133.02 | -0.06 | 8.24  | -       | -       |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 이동평균

(단위 : %, pt)

|       | 이동평균선  |        |        |        |
|-------|--------|--------|--------|--------|
|       | 5MA    | 10MA   | 20MA   | 60MA   |
| NKTB  | 111.98 | 111.98 | 112.05 | 111.74 |
| 10KTB | 133.36 | 133.29 | 133.61 | 132.64 |
| KT3Y  | 0.855  | 0.866  | 0.853  | 0.953  |
| KT5Y  | 1.134  | 1.148  | 1.123  | 1.206  |
| KT10Y | 1.401  | 1.414  | 1.386  | 1.462  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Basket 수익률과 헷지비율

(단위 : %, 계약)

| NKTB009 | 수익률   | 3선 헷지비율<br>10선 헷지비율 | NKTB012 | 수익률   | 3선 헷지비율<br>10선 헷지비율 | 10KTB009 | 수익률   | 3선 헷지비율<br>10선 헷지비율 | 10KTB012 | 수익률   | 3선 헷지비율<br>10선 헷지비율 |
|---------|-------|---------------------|---------|-------|---------------------|----------|-------|---------------------|----------|-------|---------------------|
| 국고 19-7 | 0.889 | 77.9<br>22.4        | 국고 20-3 | 0.875 | 93.2<br>26.8        | 국고 19-4  | 1.405 | 272.1<br>78.2       | 국고 20-4  | 1.408 | 293.6<br>84.3       |
| 국고 19-3 | 0.840 | 62.7<br>18.0        | 국고 19-7 | 0.889 | 77.9<br>22.4        | 국고 19-8  | 1.408 | 279.7<br>80.9       | 국고 19-8  | 1.408 | 279.7<br>80.9       |
| 국고 20-1 | 1.146 | 146.7<br>42.2       | 국고 20-1 | 1.146 | 146.8<br>42.2       |          |       |                     |          |       |                     |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

|       | 금리    | 전일비   | 1주대비  | 4주대비  |
|-------|-------|-------|-------|-------|
| CD91일 | 0.790 | 0.000 | 0.000 | 0.000 |
| 통안1년  | 0.714 | 0.016 | 0.053 | 0.055 |
| 국고1년  | 0.749 | 0.013 | 0.029 | 0.031 |
| 국고3년  | 0.874 | 0.014 | 0.034 | 0.037 |
| 국고5년  | 1.147 | 0.016 | 0.025 | 0.034 |
| 국고10년 | 1.409 | 0.007 | 0.011 | 0.026 |
| 국고20년 | 1.557 | 0.004 | 0.029 | 0.042 |
| 국고30년 | 1.572 | 0.002 | 0.026 | 0.030 |
| 국고50년 | 1.571 | 0.001 | 0.025 | 0.029 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인     | 금융투자     | 투신      | 은행      | 보험     |
|----|---------|----------|---------|---------|--------|
| 당일 | -1,327  | 1,905    | -886    | -587    | 451    |
| 1주 | 28,716  | -33,530  | -2,460  | 6,993   | 388    |
| 2주 | 16,430  | -26,894  | -43     | 1,356   | 468    |
| 4주 | -8,228  | -6,292   | 2,440   | 6,030   | -1,295 |
| 누적 | 246,910 | -211,974 | -33,701 | -17,978 | -9,750 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 기술적 지표

|        | NKTB009 | 10KTB009 |
|--------|---------|----------|
| 2차저항   | 111.99  | 133.73   |
| 1차저항   | 111.93  | 133.50   |
| PIVOT  | 111.86  | 133.16   |
| 1차지지   | 111.80  | 132.93   |
| 2차지지   | 111.73  | 132.59   |
| Demark | High    | 133.62   |
|        | Low     | 133.05   |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS/IRS

(단위 : %, %p)

|     | CRS    |       | IRS   |       | CRS-IRS |
|-----|--------|-------|-------|-------|---------|
|     | 중간값    | 전일비   | 중간값   | 전일비   | Basis   |
| 1년  | -0.175 | 0.070 | 0.773 | 0.013 | -0.948  |
| 2년  | -0.270 | 0.050 | 0.813 | 0.013 | -1.083  |
| 3년  | -0.210 | 0.045 | 0.853 | 0.018 | -1.063  |
| 4년  | -0.155 | 0.045 | 0.878 | 0.018 | -1.033  |
| 5년  | -0.095 | 0.045 | 0.893 | 0.018 | -0.988  |
| 7년  | 0.025  | 0.045 | 0.920 | 0.020 | -0.895  |
| 10년 | 0.160  | 0.045 | 0.970 | 0.023 | -0.810  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인    | 금융투자    | 투신  | 은행     | 보험     |
|----|--------|---------|-----|--------|--------|
| 당일 | 2,271  | -1,064  | 263 | -1,115 | -75    |
| 1주 | 9,578  | -10,688 | 357 | 620    | 78     |
| 2주 | 6,419  | -10,735 | 281 | 1,926  | 1,018  |
| 4주 | 7,886  | -14,687 | 855 | 3,436  | 1,684  |
| 누적 | 85,363 | -71,486 | 712 | -3,954 | -4,795 |

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.