

KTB Futures

(단위 : pt, %, 계약)

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	미결제약정
NKTB009	111.88	112.03	111.87	112.02	0.16	0.928%	112.03	-0.01	2.82	97,901	345,592
NKTB012	111.79	111.79	111.79	111.79	-0.05	1.001%	111.94	-0.15	2.82	-	-
10KTB009	133.27	133.73	133.27	133.57	0.29	1.392%	133.53	0.04	8.25	53,308	154,395
10KTB012	132.95	132.95	132.95	132.95	-0.01	1.449%	133.35	-0.40	8.24	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : %, pt)

	이동평균선			
	5MA	10MA	20MA	60MA
NKTB	111.96	111.99	112.05	111.75
10KTB	133.35	133.33	133.58	132.70
KT3Y	0.856	0.861	0.852	0.949
KT5Y	1.132	1.141	1.123	1.201
KT10Y	1.399	1.408	1.388	1.458

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헷지비율

(단위 : %, 계약)

NKTB009	수익률	3선 헷지비율 10선 헷지비율	NKTB012	수익률	3선 헷지비율 10선 헷지비율	10KTB009	수익률	3선 헷지비율 10선 헷지비율	10KTB012	수익률	3선 헷지비율 10선 헷지비율
국고 19-7	0.845	77.8 22.3	국고 20-3	0.837	93.3 26.7	국고 19-4	1.377	271.7 77.9	국고 20-4	1.381	293.3 84.1
국고 19-3	0.802	62.5 17.9	국고 19-7	0.845	78.0 22.3	국고 19-8	1.381	279.3 80.7	국고 19-8	1.381	279.3 80.7
국고 20-1	1.103	146.7 42.0	국고 20-1	1.103	147.1 42.0						

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	0.790	0.000	0.000	0.000
통안1년	0.699	-0.015	0.040	0.030
국고1년	0.730	-0.019	0.012	0.009
국고3년	0.842	-0.032	0.005	0.001
국고5년	1.105	-0.042	-0.008	-0.020
국고10년	1.370	-0.039	-0.013	-0.018
국고20년	1.518	-0.039	0.003	-0.011
국고30년	1.557	-0.015	0.015	-0.004
국고50년	1.556	-0.015	0.014	-0.006

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-3,238	5,791	1,483	-3,295	67
1주	25,526	-23,357	-745	-52	367
2주	19,254	-21,266	832	-2,647	610
4주	-15,350	4,707	4,641	285	-1,156
누적	243,672	-206,183	-32,218	-21,273	-9,683

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

	NKTB009	10KTB009
2차저항	112.13	133.98
1차저항	112.08	133.78
PIVOT	PIVOT	111.97
1차지지	111.92	133.32
2차지지	111.81	133.06
Demark	High	112.11
	Low	111.95

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

(단위 : %, %p)

	CRS		IRS		CRS-IRS
	중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
1년	-0.180	-0.005	0.768	-0.005	-0.948
2년	-0.285	-0.015	0.798	-0.015	-1.083
3년	-0.225	-0.015	0.830	-0.023	-1.055
4년	-0.170	-0.015	0.850	-0.028	-1.020
5년	-0.105	-0.010	0.863	-0.030	-0.968
7년	0.015	-0.010	0.888	-0.033	-0.873
10년	0.150	-0.010	0.938	-0.033	-0.788

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	4,209	-3,995	-27	-274	206
1주	14,900	-15,300	194	-32	237
2주	11,379	-14,755	490	1,458	346
4주	13,605	-18,658	139	2,074	2,013
누적	89,572	-75,481	685	-4,228	-4,589

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.