KTB Futures Daily

2020-07-06(월)

www.futures.co.kr

* 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
NKTB009	112.09	112.11	112.05	112.06	-0.02	0.915%	112.07	-0.01	2.82	46,736	367,598
NKTB012	111.96	111.96	111.96	111.96	0.00	0.947%	111.95	0.01	2.82	-	-
10KTB009	133.63	133.68	133.41	133.50	-0.05	1.399%	133.47	0.03	8.25	34,199	154,112
10KTB012	133.34	133.34	133.34	133.34	0.01	1.413%	133.25	0.09	8.25	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : %, pt)

	이동평균선			
	5MA	10MA	20MA	60MA
NKTB	112.06	112.08	112.03	111.90
10KTB	133.54	133.67	133.53	133.15
KTB3Y	0.840	0.832	0.844	0.902
KTB5Y	1.113	1.104	1.120	1.159
KTB10Y	1.381	1.371	1.386	1.420

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

		NKTB009	10KTB009
PIVOT	2차저항	112.13	133.80
	1차저항	112.10	133.65
	PIVOT	112.07	133.53
	1차지지	112.04	133.38
	2차지지	112.01	133.26
Demark	High	112.09	133.59
	Low	112.03	133.32

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	0.825	76.4 21.9	국고 20-3	0.837	91.7 26.3	국고 19-4	1.381	271.2 77.6	국고 20-4	1.390	292.7 83.8
국고 19-3	0.770	61.1 17.5	국고 19-7	0.825	76.5 21.9	국고 19-8	1.390	278.8 80.4	국고 19-8	1.390	278.8 80.4
국고 20-1	1.116	145.1 41.7	국고 20-1	1.116	145.3 41.7						

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	0.790	0.000	0.000	0.000
통안1년	0.648	-0.002	-0.017	-0.029
국고1년	0.703	0.002	0.002	-0.014
국고3년	0.838	0.007	0.027	-0.004
국고5년	1.115	0.001	0.044	0.020
국고10년	1.387	0.010	0.060	0.022
국고20년	1.575	0.004	0.049	0.017
국고30년	1.595	0.005	0.044	0.008
국고50년	1.597	0.004	0.046	0.011

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

(단위 : %, %p)

	CRS		IRS		CRS-IRS
	중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
1년	-0.080	-0.010	0.768	0.000	-0.848
2년	-0.195	-0.010	0.808	0.000	-1.003
3년	-0.155	-0.010	0.843	0.000	-0.998
4년	-0.095	-0.010	0.880	0.005	-0.975
5년	-0.005	-0.010	0.900	0.005	-0.905
7년	0.115	-0.010	0.928	0.005	-0.813
10년	0.230	-0.010	0.978	0.003	-0.748

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-91	1,710	779	-2,420	103
1주	2,067	-9,061	1,720	5,595	-113
2주	35,604	-28,699	1,429	4,834	-996
4주	56,769	-53,243	3,228	5,785	-474
누적	278,694	-233,772	-30,552	-16,523	-10,818

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-267	-113	-488	795	61
1주	-3,813	4,846	-1,568	125	531
2주	239	7,694	-2,456	-2,396	-184
4주	16,319	-11,546	-2,331	-436	652
누적	93,334	-70,601	-2,302	-5,989	-5,195

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

본 자료는 투자의 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.