

KTB Futures

(단위 : pt, %, 계약)

| 종목 | 시가 | 고가 | 저가 | 종가 | 전일비 | 선물수익률 | 이론가 | 저평가 | M.Dur | 거래량 | 미결제약정 |
|----------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|-------|-------|--------|---------|
| NKTB009 | 111.99 | 112.01 | 111.96 | 111.97 | -0.06 | 0.944% | 111.99 | -0.02 | 2.82 | 59,683 | 381,006 |
| NKTB012 | 111.99 | 111.99 | 111.99 | 111.99 | 0.00 | 0.938% | 111.87 | 0.12 | 2.82 | - | - |
| 10KTB009 | 133.28 | 133.32 | 133.10 | 133.17 | -0.22 | 1.429% | 133.13 | 0.04 | 8.24 | 50,526 | 157,644 |
| 10KTB012 | 133.34 | 133.34 | 133.34 | 133.34 | 0.00 | 1.413% | 132.89 | 0.45 | 8.25 | - | - |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : %, pt)

| | 이동평균선 | | | |
|-------|--------|--------|--------|--------|
| | 5MA | 10MA | 20MA | 60MA |
| NKTB | 112.04 | 112.04 | 112.04 | 111.95 |
| 10KTB | 133.40 | 133.41 | 133.52 | 133.26 |
| KT3Y | 0.846 | 0.844 | 0.841 | 0.886 |
| KT5Y | 1.122 | 1.122 | 1.115 | 1.147 |
| KT10Y | 1.395 | 1.392 | 1.383 | 1.412 |

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 | 0.844 | 75.7 21.8 | 국고 20-3 | 0.860 | 90.9 26.2 | 국고 19-4 | 1.413 | 270.1 77.6 | 국고 20-4 | 1.421 | 291.6 83.8 |
| 국고 19-3 | 0.785 | 60.4 17.4 | 국고 19-7 | 0.844 | 75.7 21.8 | 국고 19-8 | 1.422 | 277.8 80.4 | 국고 19-8 | 1.422 | 277.8 80.4 |
| 국고 20-1 | 1.146 | 144.4 41.6 | 국고 20-1 | 1.146 | 144.4 41.6 | | | | | | |

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 | 0.005 | -0.006 | 0.004 |
| 국고1년 | 0.710 | 0.007 | 0.000 | 0.009 |
| 국고3년 | 0.860 | 0.011 | 0.006 | 0.017 |
| 국고5년 | 1.146 | 0.021 | 0.010 | 0.030 |
| 국고10년 | 1.420 | 0.023 | 0.010 | 0.032 |
| 국고20년 | 1.591 | 0.021 | 0.003 | 0.026 |
| 국고30년 | 1.598 | 0.019 | -0.010 | 0.019 |
| 국고50년 | 1.601 | 0.017 | -0.008 | 0.019 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인 | 금융투자 | 투신 | 은행 | 보험 |
|----|---------|----------|---------|---------|---------|
| 당일 | -2,940 | -7,978 | -272 | 6,467 | 319 |
| 1주 | 10,385 | -10,122 | -3,081 | -226 | -736 |
| 2주 | -2,625 | -7,600 | -288 | 4,966 | -676 |
| 4주 | 41,608 | -35,277 | 844 | 2,735 | -1,186 |
| 누적 | 285,695 | -246,549 | -32,804 | -14,342 | -11,360 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

| | NKTB009 | 10KTB009 |
|--------|---------|----------|
| 2차저항 | 112.03 | 133.42 |
| 1차저항 | 112.00 | 133.29 |
| PIVOT | PIVOT | 111.98 |
| 1차지지 | 111.95 | 133.07 |
| 2차지지 | 111.93 | 132.98 |
| Demark | High | 111.99 |
| | Low | 111.94 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

(단위 : %, %p)

| | CRS | | IRS | | CRS-IRS |
|-----|--------|-------|-------|-------|---------|
| | 중간값 | 전일비 | 중간값 | 전일비 | Basis |
| 1년 | -0.055 | 0.025 | 0.788 | 0.015 | -0.843 |
| 2년 | -0.140 | 0.025 | 0.828 | 0.020 | -0.968 |
| 3년 | -0.135 | 0.025 | 0.875 | 0.023 | -1.010 |
| 4년 | -0.095 | 0.025 | 0.913 | 0.025 | -1.008 |
| 5년 | -0.025 | 0.025 | 0.938 | 0.028 | -0.963 |
| 7년 | 0.095 | 0.025 | 0.958 | 0.028 | -0.863 |
| 10년 | 0.210 | 0.025 | 0.998 | 0.025 | -0.788 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인 | 금융투자 | 투신 | 은행 | 보험 |
|----|--------|---------|--------|--------|--------|
| 당일 | 669 | -1,822 | -127 | 496 | 263 |
| 1주 | 4,952 | -5,252 | 104 | -105 | -199 |
| 2주 | 3,307 | -3,580 | -1,895 | -142 | 109 |
| 4주 | 14,059 | -5,969 | -2,827 | -3,330 | -666 |
| 누적 | 93,858 | -73,983 | -1,832 | -5,849 | -5,348 |

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.