

## KTB Futures

(단위 : pt, %, 계약)

| 종목       | 시가     | 고가     | 저가     | 종가     | 전일비   | 선물수익률  | 이론가    | 저평가   | M.Dur | 거래량    | 미결제약정   |
|----------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|-------|-------|--------|---------|
| NKTB009  | 112.20 | 112.21 | 112.17 | 112.19 | 0.03  | 0.874% | 112.20 | -0.01 | 2.82  | 33,497 | 401,752 |
| NKTB012  | 112.10 | 112.10 | 112.10 | 112.10 | -0.05 | 0.903% | 112.11 | -0.01 | 2.82  | -      | -       |
| 10KTB009 | 134.65 | 134.70 | 134.49 | 134.64 | 0.22  | 1.296% | 134.57 | 0.07  | 8.26  | 43,631 | 174,957 |
| 10KTB012 | 134.24 | 134.24 | 134.24 | 134.24 | -0.21 | 1.332% | 134.29 | -0.05 | 8.26  | -      | -       |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 이동평균

(단위 : %, pt)

|       | 이동평균선  |        |        |        |
|-------|--------|--------|--------|--------|
|       | 5MA    | 10MA   | 20MA   | 60MA   |
| NKTB  | 112.20 | 112.18 | 112.11 | 112.06 |
| 10KTB | 134.60 | 134.34 | 133.86 | 133.66 |
| KT3Y  | 0.805  | 0.809  | 0.827  | 0.847  |
| KT5Y  | 1.057  | 1.070  | 1.099  | 1.115  |
| KT10Y | 1.313  | 1.333  | 1.365  | 1.380  |

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 | 0.785 | 74.3<br>21.1        | 국고 20-3 | 0.810 | 89.6<br>25.5        | 국고 19-4  | 1.285 | 270.4<br>76.3       | 국고 20-4  | 1.306 | 291.8<br>82.4       |
| 국고 19-3 | 0.741 | 58.9<br>16.8        | 국고 19-7 | 0.785 | 74.4<br>21.1        | 국고 19-8  | 1.299 | 278.0<br>79.0       | 국고 19-8  | 1.299 | 278.0<br>79.0       |
| 국고 20-1 | 1.061 | 143.3<br>40.7       | 국고 20-1 | 1.061 | 143.5<br>40.7       |          |       |                     |          |       |                     |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

|       | 금리    | 전일비    | 1주대비   | 4주대비   |
|-------|-------|--------|--------|--------|
| CD91일 | 0.780 | 0.000  | -0.010 | 0.000  |
| 통안1년  | 0.609 | -0.002 | -0.009 | 0.002  |
| 국고1년  | 0.673 | -0.004 | -0.007 | 0.001  |
| 국고3년  | 0.811 | -0.002 | 0.001  | 0.013  |
| 국고5년  | 1.063 | -0.011 | -0.008 | 0.015  |
| 국고10년 | 1.309 | -0.020 | -0.037 | -0.009 |
| 국고20년 | 1.496 | -0.010 | -0.052 | -0.018 |
| 국고30년 | 1.495 | -0.009 | -0.062 | -0.029 |
| 국고50년 | 1.494 | -0.010 | -0.063 | -0.032 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인     | 금융투자     | 투신      | 은행      | 보험      |
|----|---------|----------|---------|---------|---------|
| 당일 | -581    | 207      | 1,810   | -1,200  | -601    |
| 1주 | -3,500  | 5,099    | 1,469   | -3,475  | -680    |
| 2주 | 22,825  | -9,291   | -49     | -8,832  | -3,089  |
| 4주 | 30,594  | -10,916  | -3,007  | -17,294 | -3,304  |
| 누적 | 316,954 | -253,684 | -34,313 | -31,975 | -13,984 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 기술적 지표

|        | NKTB009 | 10KTB009 |
|--------|---------|----------|
| 2차저항   | 112.23  | 134.82   |
| 1차저항   | 112.21  | 134.73   |
| PIVOT  | PIVOT   | 112.19   |
| 1차지지   | 112.17  | 134.52   |
| 2차지지   | 112.15  | 134.40   |
| Demark | High    | 112.20   |
|        | Low     | 112.16   |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS/IRS

(단위 : %, %p)

|     | CRS    |        | IRS   |        | CRS-IRS |
|-----|--------|--------|-------|--------|---------|
|     | 중간값    | 전일비    | 중간값   | 전일비    | Basis   |
| 1년  | -0.015 | -0.005 | 0.745 | -0.003 | -0.760  |
| 2년  | -0.065 | -0.010 | 0.773 | -0.008 | -0.838  |
| 3년  | -0.060 | -0.015 | 0.803 | -0.010 | -0.863  |
| 4년  | -0.020 | -0.025 | 0.830 | -0.010 | -0.850  |
| 5년  | 0.030  | -0.025 | 0.853 | -0.010 | -0.823  |
| 7년  | 0.160  | -0.020 | 0.870 | -0.013 | -0.710  |
| 10년 | 0.265  | -0.020 | 0.918 | -0.013 | -0.653  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인     | 금융투자    | 투신     | 은행     | 보험     |
|----|---------|---------|--------|--------|--------|
| 당일 | 2,597   | -1,270  | -621   | -855   | 96     |
| 1주 | 1,498   | 1,482   | -972   | -1,072 | -585   |
| 2주 | 15,676  | -7,371  | -3,880 | -1,050 | -1,107 |
| 4주 | 20,989  | -12,441 | -4,327 | -2,473 | -1,472 |
| 누적 | 109,951 | -80,352 | -6,057 | -7,355 | -6,765 |

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