# KTB Futures Daily

2020-11-06(금)

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| NKTB012 | 111.74 | 111.79 | 111.72 | 111.79 | 0.11 | 1.001% | 111.79 | 0.00 | 2.82 | 82,084 | 400,200 |
| NKTB103 | 111.46 | 111.46 | 111.46 | 111.46 | -0.04 | 1.106% | 111.66 | -0.20 | 2.82 | - | - |
| 10KTB012 | 131.86 | 132.12 | 131.86 | 132.12 | 0.48 | 1.525% | 132.04 | 0.08 | 8.23 | 56,722 | 156,542 |
| 10KTB103 | 132.05 | 132.05 | 132.05 | 132.05 | 0.45 | 1.531% | 131.78 | 0.27 | 8.23 | 1 | 15 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 이동평균

(단위 : %, pt)

| | 이동평균선 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 5MA | 10MA | 20MA | 60MA |
| NKTB | 111.69 | 111.77 | 111.81 | 111.92 |
| 10KTB | 131.60 | 131.99 | 132.15 | 132.66 |
| KTB3Y | 0.954 | 0.934 | 0.921 | 0.893 |
| KTB5Y | 1.262 | 1.232 | 1.212 | 1.175 |
| KTB10Y | 1.570 | 1.536 | 1.520 | 1.478 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 기술적 지표

| | | NKTB012 | 10KTB012 |
|---|---|---|---|
| PIVOT | 2차저항 | 111.84 | 132.29 |
| | 1차저항 | 111.81 | 132.21 |
| | PIVOT | 111.77 | 132.03 |
| | 1차지지 | 111.74 | 131.95 |
| | 2차지지 | 111.70 | 131.77 |
| Demark | High | 111.83 | 132.25 |
| | Low | 111.76 | 131.99 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Basket 수익률과 헷지비율

(단위 : %, 계약)

| NKTB012 | 수익률 | 3선 헷지비율<br>10선 헷지비율 | NKTB103 | 수익률 | 3선 헷지비율<br>10선 헷지비율 | 10KTB012 | 수익률 | 3선 헷지비율<br>10선 헷지비율 | 10KTB103 | 수익률 | 3선 헷지비율<br>10선 헷지비율 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 국고 20-3 | 0.926 | 81.1<br>23.5 | 국고 20-3 | 0.926 | 81.1<br>23.5 | 국고 20-4 | 1.526 | 278.9<br>80.8 | 국고 20-4 | 1.526 | 278.9<br>80.8 |
| 국고 19-7 | 0.853 | 65.9<br>19.1 | 국고 19-7 | 0.853 | 65.9<br>19.1 | 국고 19-8 | 1.514 | 265.8<br>77.0 | 국고 19-8 | 1.514 | 265.8<br>77.0 |
| 국고 20-1 | 1.178 | 134.6<br>39.0 | 국고 20-6 | 1.221 | 148.0<br>42.9 | | | | | | |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

| | 금리 | 전일비 | 1주대비 | 4주대비 |
|---|---|---|---|---|
| CD91일 | 0.660 | -0.010 | 0.030 | 0.030 |
| 통안1년 | 0.705 | -0.010 | 0.003 | 0.002 |
| 국고1년 | 0.681 | -0.012 | 0.003 | 0.001 |
| 국고3년 | 0.927 | -0.028 | 0.000 | -0.008 |
| 국고5년 | 1.223 | -0.043 | 0.005 | -0.012 |
| 국고10년 | 1.527 | -0.042 | 0.000 | -0.019 |
| 국고20년 | 1.668 | -0.017 | 0.030 | 0.023 |
| 국고30년 | 1.671 | -0.016 | 0.019 | 0.020 |
| 국고50년 | 1.671 | -0.016 | 0.020 | 0.019 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS/IRS

(단위 : %, %p)

| | CRS | | IRS | | CRS-IRS |
|---|---|---|---|---|---|
| | 중간값 | 전일비 | 중간값 | 전일비 | Basis |
| 1년 | 0.130 | 0.045 | 0.698 | -0.013 | -0.568 |
| 2년 | 0.145 | 0.045 | 0.765 | -0.025 | -0.620 |
| 3년 | 0.175 | 0.035 | 0.835 | -0.038 | -0.660 |
| 4년 | 0.180 | 0.035 | 0.895 | -0.050 | -0.715 |
| 5년 | 0.205 | 0.040 | 0.935 | -0.055 | -0.730 |
| 7년 | 0.420 | 0.040 | 0.988 | -0.063 | -0.568 |
| 10년 | 0.600 | 0.040 | 1.053 | -0.070 | -0.453 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인 | 금융투자 | 투신 | 은행 | 보험 |
|---|---|---|---|---|---|
| 당일 | 2,813 | 441 | -1,337 | 997 | -402 |
| 1주 | -21,122 | 18,059 | 2,516 | 871 | -312 |
| 2주 | -20,096 | 23,523 | 162 | -2,775 | -1,044 |
| 4주 | -16,344 | 19,079 | -1,296 | 1,108 | -1,157 |
| 누적 | 273,257 | -216,145 | -38,861 | -14,509 | -11,162 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인 | 금융투자 | 투신 | 은행 | 보험 |
|---|---|---|---|---|---|
| 당일 | 405 | -1,301 | -502 | 2,116 | -98 |
| 1주 | -4,311 | 4,857 | 525 | -2,033 | 841 |
| 2주 | -1,905 | 5,939 | -1,822 | -2,221 | 217 |
| 4주 | -7,331 | 10,556 | -2,378 | -1,789 | 970 |
| 누적 | 95,821 | -71,482 | -7,433 | -12,873 | -3,989 |

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.