KTB Futures Daily

2020-12-14(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
NKTB012	111.71	111.72	111.68	111.72	0.02	1.023%	111.71	0.01	2.82	58,173	270,856
NKTB103	111.55	111.59	111.54	111.57	0.03	1.071%	111.55	0.02	2.82	8,214	94,926
10KTB012	130.89	130.89	130.64	130.81	0.01	1.646%	130.77	0.04	8.22	47,142	99,517
10KTB103	130.61	130.66	130.41	130.55	0.02	1.670%	130.45	0.10	8.21	3,537	46,941

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : %, pt)

	이동평균선			
	5MA	10MA	20MA	60MA
NKTB	111.69	111.64	111.65	111.76
10KTB	130.83	130.79	130.98	131.78
KTB3Y	0.965	0.973	0.968	0.933
KTB5Y	1.314	1.326	1.312	1.242
KTB10Y	1.651	1.655	1.635	1.556

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

		NKTB012	10KTB012
PIVOT	2차저항	111.75	131.03
	1차저항	111.73	130.92
	PIVOT	111.71	130.78
	1차지지	111.69	130.67
	2차지지	111.67	130.53
Demark	High	111.74	130.85
	Low	111.70	130.60

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헷지비율

(단위 : %, 계약)

NKTB012	수익률	3선 헷지비율 10선 헷지비율	NKTB103	수익률	3선 헷지비율 10선 헷지비율	10KTB012	수익률	3선 헷지비율 10선 헷지비율	10KTB103	수익률	3선 헷지비율 10선 헷지비율
국고 20-3	0.978	77.8 22.8	국고 20-3	0.978	77.8 22.8	국고 20-4	1.648	273.8 80.2	국고 20-4	1.648	273.8 80.2
국고 19-7	0.881	62.6 18.3	국고 19-7	0.881	62.6 18.3	국고 19-8	1.630	260.9 76.4	국고 19-8	1.630	260.9 76.4
국고 20-1	1.296	131.3 38.4	국고 20-6	1.333	144.6 42.4						

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	0.660	0.000	0.000	0.000
통안1년	0.718	0.000	-0.004	-0.002
국고1년	0.710	0.000	-0.004	0.000
국고3년	0.973	0.007	-0.002	0.007
국고5년	1.301	-0.017	-0.036	-0.022
국고10년	1.655	-0.001	-0.014	0.000
국고20년	1.762	0.000	0.015	0.013
국고30년	1.757	-0.001	0.017	0.013
국고50년	1.757	-0.001	0.018	0.014

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

(단위 : %, %p)

	CRS		IRS		CRS-IRS
	중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
1년	0.250	0.000	0.730	0.000	-0.480
2년	0.285	0.000	0.835	0.000	-0.550
3년	0.295	0.000	0.925	0.000	-0.630
4년	0.315	0.000	1.010	0.000	-0.695
5년	0.355	0.000	1.065	0.000	-0.710
7년	0.535	-0.005	1.135	0.000	-0.600
10년	0.715	-0.005	1.215	0.000	-0.500

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-4,632	4,453	-479	1,731	329
1주	15,318	-292	-282	-1,854	956
2주	14,216	3,890	-425	-4,777	1,293
4주	-6,833	22,633	4,897	-6,452	443
누적	252,028	-185,496	-35,372	-14,424	-8,716

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-5,196	4,506	431	215	30
1주	-11,001	8,304	1,384	1,461	639
2주	-23,793	19,023	2,588	1,172	572
4주	-32,355	21,623	3,816	3,707	932
누적	60,681	-50,794	-1,857	-8,091	-2,359

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.