

KTB Futures

(단위 : pt, %, 계약)

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	선물수익률	이론가	저평가	M.Dur	거래량	미결제약정
NKTB103	111.53	111.59	111.51	111.58	0.06	1.068%	111.59	-0.01	2.82	112,523	325,098
NKTB106	111.36	111.36	111.36	111.36	0.02	1.138%	111.38	-0.02	2.82	-	-
10KTB103	129.70	130.03	129.63	129.78	0.06	1.742%	129.76	0.02	8.20	55,796	126,651
10KTB106	129.10	129.10	129.10	129.10	0.00	1.806%	129.36	-0.26	8.20	-	21

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : %, pt)

	이동평균선			
	5MA	10MA	20MA	60MA
NKTB	111.57	111.56	111.53	111.63
10KTB	129.86	129.80	129.98	130.85
KT3Y	0.977	0.967	0.965	0.962
KT5Y	1.313	1.314	1.319	1.298
KT10Y	1.719	1.719	1.705	1.640

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	0.939	75.0 22.1	국고 20-8	0.970	90.2 26.6	국고 20-4	1.732	269.7 79.6	국고 20-9	1.729	284.5 84.0
국고 19-7	0.865	59.7 17.6	국고 20-3	0.939	75.0 22.1	국고 19-8	1.713	257.1 75.9	국고 20-4	1.732	269.7 79.6
국고 20-6	1.311	141.9 41.9	국고 20-6	1.311	141.9 41.9						

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	0.670	0.000	0.010	0.010
통안1년	0.679	-0.004	-0.011	-0.004
국고1년	0.699	-0.002	-0.008	-0.001
국고3년	0.973	-0.015	-0.005	0.004
국고5년	1.314	-0.010	-0.012	0.013
국고10년	1.731	-0.003	0.002	0.039
국고20년	1.825	0.008	0.007	0.035
국고30년	1.828	0.008	0.011	0.026
국고50년	1.827	0.007	0.010	0.025

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-11,315	13,407	-68	-1,294	56
1주	-17,328	24,810	356	-5,890	-275
2주	-8,281	20,391	255	-10,154	9
4주	-8,218	25,131	4,018	-11,980	-345
누적	232,744	-150,332	-32,151	-22,622	-8,838

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

	NKTB012	10KTB012
2차저항	111.64	130.21
1차저항	111.61	130.00
PIVOT	PIVOT	111.56
1차지지	111.53	129.60
2차지지	111.48	129.41
Demark	High	111.63
	Low	111.55
		129.71

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

(단위 : %, %p)

	CRS		IRS		CRS-IRS
	중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
1년	0.140	-0.015	0.755	-0.015	-0.615
2년	0.175	-0.020	0.878	-0.015	-0.703
3년	0.215	-0.015	0.978	-0.013	-0.763
4년	0.250	-0.015	1.065	-0.005	-0.815
5년	0.295	-0.015	1.130	-0.003	-0.835
7년	0.450	-0.015	1.210	-0.008	-0.760
10년	0.640	-0.015	1.300	-0.008	-0.660

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
당일	-651	1,329	4	-1,175	-6
1주	-7,593	11,110	-472	-3,481	309
2주	-9,776	9,656	2,109	-4,119	-24
4주	-8,943	9,539	3,459	-7,887	1,490
누적	46,437	-32,236	2,069	-18,314	-906

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.