

* 당사 사정으로 KTB Futures는 데이터 파일로 상황을 대체합니다. 감사합니다.

KTB Futures

(단위 : pt, %, 계약)

| 종목 | 시가 | 고가 | 저가 | 종가 | 전일비 | 선물수익률 | 이론가 | 저평가 | M.Dur | 거래량 | 미결제약정 |
|----------|--------|--------|--------|--------|------|--------|--------|-------|-------|--------|---------|
| NKTB103 | 111.61 | 111.65 | 111.59 | 111.59 | 0.02 | 1.064% | 111.66 | -0.07 | 2.82 | 86,940 | 366,925 |
| NKTB106 | 111.40 | 111.40 | 111.40 | 111.40 | 0.00 | 1.125% | 111.41 | -0.01 | 2.82 | - | - |
| 10KTB103 | 129.05 | 129.15 | 128.96 | 129.03 | 0.12 | 1.813% | 129.06 | -0.03 | 8.20 | 41,526 | 130,370 |
| 10KTB106 | 128.30 | 128.30 | 128.30 | 128.30 | 0.10 | 1.882% | 128.49 | -0.19 | 8.19 | 1 | 26 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : %, pt)

| | 이동평균선 | | | |
|--------|--------|--------|--------|--------|
| | 5MA | 10MA | 20MA | 60MA |
| NKTB | 111.60 | 111.57 | 111.56 | 111.58 |
| 10KTB | 129.25 | 129.38 | 129.60 | 130.23 |
| KTB3Y | 0.987 | 0.984 | 0.984 | 0.973 |
| KTB5Y | 1.319 | 1.324 | 1.319 | 1.317 |
| KTB10Y | 1.797 | 1.784 | 1.758 | 1.697 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

| | NKTB012 | 10KTB012 |
|--------|---------|----------|
| 2차저항 | 111.66 | 129.23 |
| 1차저항 | 111.62 | 129.09 |
| PIVOT | 111.58 | 128.97 |
| 1차지지 | 111.54 | 128.83 |
| 2차지지 | 111.50 | 128.71 |
| Demark | | |
| High | 111.60 | 129.03 |
| Low | 111.52 | 128.77 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헷지비율

(단위 : %, 계약)

| NKTB0103 | 수익률 | 3선 헷지비율 10선 헷지비율 | NKTB106 | 수익률 | 3선 헷지비율 10선 헷지비율 | 10KTB103 | 수익률 | 3선 헷지비율 10선 헷지비율 | 10KTB106 | 수익률 | 3선 헷지비율 10선 헷지비율 |
|----------|-------|---------------------|---------|-------|---------------------|----------|-------|---------------------|----------|-------|---------------------|
| 국고 20-3 | 0.932 | 72.6 21.6 | 국고 20-8 | 0.993 | 87.8 26.1 | 국고 20-4 | 1.831 | 265.2 78.9 | 국고 20-9 | 1.830 | 279.7 83.2 |
| 국고 19-7 | 0.841 | 57.3 17.0 | 국고 20-3 | 0.932 | 72.6 21.6 | 국고 19-8 | 1.782 | 253.5 75.4 | 국고 20-4 | 1.831 | 265.2 78.9 |
| 국고 20-6 | 1.335 | 139.4 41.5 | 국고 20-6 | 1.335 | 139.4 41.5 | | | | | | |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

| | 금리 | 전일비 | 1주대비 | 4주대비 |
|-------|-------|--------|--------|--------|
| CD91일 | 0.730 | 0.000 | 0.000 | 0.000 |
| 통안1년 | 0.684 | 0.005 | -0.005 | -0.005 |
| 국고1년 | 0.673 | 0.003 | 0.004 | 0.003 |
| 국고3년 | 0.996 | 0.006 | 0.018 | 0.012 |
| 국고5년 | 1.333 | 0.014 | 0.017 | 0.009 |
| 국고10년 | 1.825 | 0.012 | 0.057 | 0.032 |
| 국고20년 | 1.963 | -0.005 | 0.046 | 0.038 |
| 국고30년 | 1.970 | -0.005 | 0.043 | 0.039 |
| 국고50년 | 1.972 | -0.003 | 0.046 | 0.043 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

(단위 : %, %p)

| | CRS | | IRS | | CRS-IRS |
|-----|-------|-------|-------|-------|---------|
| | 중간값 | 전일비 | 중간값 | 전일비 | Basis |
| 1년 | 0.130 | 0.000 | 0.793 | 0.008 | -0.663 |
| 2년 | 0.205 | 0.015 | 0.910 | 0.010 | -0.705 |
| 3년 | 0.255 | 0.020 | 1.030 | 0.013 | -0.775 |
| 4년 | 0.298 | 0.028 | 1.143 | 0.010 | -0.845 |
| 5년 | 0.395 | 0.040 | 1.238 | 0.015 | -0.843 |
| 7년 | 0.560 | 0.045 | 1.350 | 0.013 | -0.790 |
| 10년 | 0.755 | 0.045 | 1.460 | 0.008 | -0.705 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인 | 금융투자 | 투신 | 은행 | 보험 |
|----|---------|---------|---------|---------|---------|
| 당일 | 163 | -1,748 | 958 | 106 | 572 |
| 1주 | -18,435 | 11,756 | 1,318 | 8,549 | 713 |
| 2주 | -11,881 | 21,734 | -3,197 | 4,852 | -743 |
| 4주 | -39,828 | 66,970 | -1,134 | 155 | -2,348 |
| 누적 | 204,231 | -96,769 | -33,217 | -21,173 | -11,242 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 일자 | 외국인 | 금융투자 | 투신 | 은행 | 보험 |
|----|---------|---------|--------|---------|------|
| 당일 | -3,615 | 3,961 | -325 | -318 | 236 |
| 1주 | -19,991 | 23,495 | -1,068 | -2,598 | 68 |
| 2주 | -12,564 | 21,244 | -1,401 | -5,404 | -421 |
| 4주 | -4,787 | 16,133 | -2,338 | -4,766 | 261 |
| 누적 | 42,301 | -17,432 | -273 | -21,905 | -639 |

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 것이며, 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.