KTB Futures Daily

2019-11-13(수)

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
NKTB912	110.00	110.11	109.82	109.86	-0.15	1.620%	109.91	-0.05	2.81	179,006	302,992
NKTB003	109.95	109.95	109.95	109.95	0.11	1.590%	109.93	0.02	2.81	-	-
10KTB912	129.02	129.54	128.49	128.55	-0.55	1.858%	128.65	-0.10	8.19	85,088	118,369
10KTB003	129.00	129.00	129.00	129.00	0.11	1.816%	128.55	0.45	8.20	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균

(단위 : %, pt)

	이동평균선			
	5MA	10MA	20MA	60MA
NKTB912	109.94	109.98	110.16	110.70
10KTB912	128.84	129.07	129.83	132.45
KTB3Y	1.531	1.514	1.462	1.314
KTB5Y	1.655	1.639	1.574	1.390
KTB10Y	1.815	1.793	1.723	1.488

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표

		NKTB912	10KTB912
PIVOT	2차저항	110.22	129.91
	1차저항	110.04	129.23
	PIVOT	109.93	128.86
	1차지지	109.75	128.18
	2차지지	109.64	127.81
Demark	High	109.99	129.05
	Low	109.70	128.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헷지비율

(단위 : %, 계약)

NKTB912	수익률	헷지비율	NKTB003	수익률	헷지비율	10KTB912	수익률	헷지비율	10KTB003	수익률	헷지비율
국고 18-9	1.545	66.22	국고 18-9	1.545	66.15	국고 19-4	1.842	83.14	국고 19-4	1.842	82.79
국고 19-1	1.690	135.16	국고 19-3	1.559	81.39	국고 18-10	1.847	80.93	국고 18-10	1.847	80.59
국고 19-3	1.559	81.47	국고 19-5	1.674	148.25						

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

(단위 : %, %p)

	금리	전일비	1주대비	4주대비
CD91일	1.530	0.000	0.040	-0.020
통안1년	1.435	0.026	0.024	0.134
국고1년	1.394	0.022	0.023	0.122
국고3년	1.564	0.064	0.042	0.283
국고5년	1.674	0.049	0.015	0.312
국고10년	1.842	0.054	0.025	0.343
국고20년	1.798	0.042	0.019	0.305
국고30년	1.766	0.033	-0.001	0.286
국고50년	1.718	-0.015	-0.049	0.238

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

(단위 : %, %p)

	CRS		IRS		CRS-IRS
	중간값	전일비	중간값	전일비	Basis
1년	0.845	0.005	1.460	0.015	-0.615
2년	0.800	-0.025	1.425	0.023	-0.625
3년	0.830	-0.015	1.435	0.020	-0.605
4년	0.825	-0.015	1.445	0.025	-0.620
5년	0.820	-0.015	1.460	0.033	-0.640
7년	0.880	-0.015	1.465	0.035	-0.585
10년	1.030	-0.015	1.495	0.035	-0.465

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
11월 12일	1,327	-292	-353	4,095	-140
11월 11일	-4,541	4,169	433	783	86
11월 8일	2,167	6,693	-2,813	-4,669	-333
11월 7일	-11,175	9,963	-272	1,207	392
11월 6일	-6,957	9,910	-2,442	-660	367
1주	-19,179	30,443	-5,447	756	372
2주	-29,446	54,319	-3,755	-947	1,184
4주	-73,515	83,933	-3,928	-12,704	3,413
누적	115,793	-105,429	-4,206	24,423	-1,949

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험
11월 12일	-1,534	165	-17	2,755	0
11월 11일	-3,616	-378	146	1,550	165
11월 8일	2,022	-3,348	-656	-938	231
11월 7일	-4,081	2,799	-231	1,294	-314
11월 6일	-4,909	1,510	1,115	-863	274
1주	-12,118	748	357	3,798	356
2주	-9,273	6,310	-1,125	5,686	193
4주	-32,088	20,376	-2,490	5,929	1,065
누적	18,832	-16,236	-7,708	-6,518	-1,589

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.