

KTB 선물 가격

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	수익률(%)	1 주 전	이론가	저평가	M.Dur	거래량	미결제약정
NKTB803	107.55	107.69	107.52	107.69	0.11	2.331%	0.27	107.73	-0.04	2.7979	120,124	241,659
NKTB806	107.43	107.43	107.43	107.43		2.418%		107.46	-0.03	2.7965	0	0
10KTB803	118.98	119.81	118.94	119.73	0.53	2.732%	0.63	119.67	0.06	8.0822	63,145	96,821
10KTB806	119.07	119.07	119.07	119.07		2.800%		119.37	-0.30	8.0737	0	0

출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균 (5일, 10일, 20일, 60일)

	5일	10일	20일	60일
NKTB803	107.57	107.53	107.62	107.90
10KTB803	119.24	119.32	119.78	121.06
국고 3년	2.257	2.258	2.226	2.157
국고 5년	2.526	2.532	2.492	2.381
국고 10년	2.774	2.725	2.675	2.561

출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표 (PIVOT)

기술적 지표	NKTB803	10KTB803
2차 저항	107.80	120.36
1차 저항	107.75	120.05
PIVOT	107.63	119.49
1차 지지	107.58	119.18
2차 지지	107.46	118.62
디마크 High	107.78	120.21
Low	107.61	119.34

출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헷지비율

NKTB803	수익률	헷지비율	NKTB803	수익률	헷지비율	10KTB803	수익률	헷지비율	10KTB803	수익률	헷지비율
국고 16-7	2.141	58.92	국고 17-6	2.246	90.31	국고 17-3	2.728	82.29	국고 17-3	2.728	82.83
국고 17-2	2.226	74.73	국고 17-2	2.226	74.95	국고 16-8	2.716	76.37	국고 17-7	2.717	87.77
국고 17-4	2.486	141.40	국고 17-4	2.486	141.82						

출처: 금융투자협회, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

	금리	전일비	1주 대비	4주 대비
CD91일	1.650	0.000	0.000	-0.010
통안증권 1년	1.829	-0.004	-0.033	-0.019
국고채권 1년	1.834	-0.006	-0.025	-0.002
국고채권 3년	2.248	-0.005	-0.026	0.076
국고채권 5년	2.494	-0.010	-0.076	0.045
국고채권 10년	2.718	-0.031	-0.051	0.081
국고채권 20년	2.686	-0.023	-0.029	0.121
국고채권 30년	2.664	-0.016	-0.019	0.117
국고채권 50년	2.665	-0.020	-0.019	0.115
회사채 AA- 3년	2.779	-0.009	-0.030	0.072
회사채 BBB- 3년	9.021	-0.006	-0.028	0.043

출처: 금융투자협회, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

	CRS		IRS		베이스스
	중간값	전일비	중간값	전일비	
1년	1.305	0.025	1.803	-0.010	-0.4975
2년	1.440	0.020	2.000	-0.020	-0.5600
3년	1.530	0.005	2.113	-0.028	-0.5825
4년	1.595	-0.005	2.185	-0.038	-0.5900
5년	1.645	-0.010	2.233	-0.043	-0.5875
7년	1.740	-0.015	2.290	-0.053	-0.5500
10년	1.880	-0.015	2.370	-0.050	-0.4900

출처: Tullet Prebon, NH선물 리서치센터

투자자별 순매수 동향(NKTB803)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험	개인
2월 7일	1,905	-2,734	153	-127	732	4
2월 6일	-7,534	-4,953	-1,706	15,978	-173	41
2월 5일	3,841	-4,989	-870	1,465	486	-38
2월 2일	-3,502	3,959	-1,291	1,443	-146	-23
2월 1일	410	17,202	-3,277	-11,952	-1,363	-157
1주	-4,880	8,485	-6,991	6,807	-464	-173
2주	5,314	6,532	-5,989	-7,751	697	2,443
4주	606	6,717	-5,951	14,806	-1,133	-10,074
누적	58,315	-52,222	-24,299	12,913	863	17,103

출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

투자자별 순매수 동향(10KTB803)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험	개인
2월 7일	2,187	-911	-361	-38	-205	-159
2월 6일	4,044	-5,684	-643	2,053	228	-81
2월 5일	1,657	536	7	-1,228	-941	24
2월 2일	396	-1,794	-258	2,095	-132	2
2월 1일	-3,254	2,173	-54	721	240	-52
1주	5,030	-5,680	-1,309	3,603	-810	-266
2주	8,189	-8,527	-631	1,557	-373	-391
4주	13,578	-11,191	203	-7,483	1,320	3,153
누적	6,735	-7,691	-8,203	1,583	-2,838	9,062

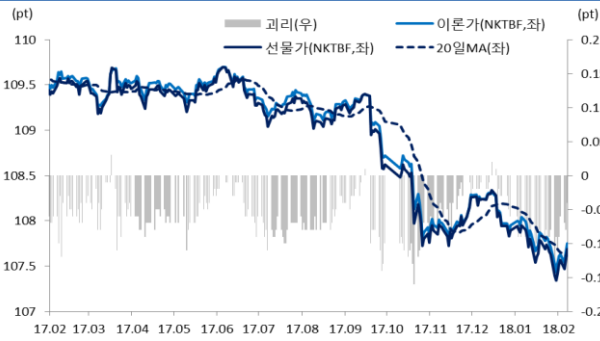
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

전일 해외시장 동향

종목	전일증가(%)	전일비(bp)	종목	전일증가(%)	전일비(bp)	종목	전일증가(%)	전일비(bp)
UST2Y	2.1051	8.10	UST10Y	2.8016	9.60	UST30Y	3.0659	5.99

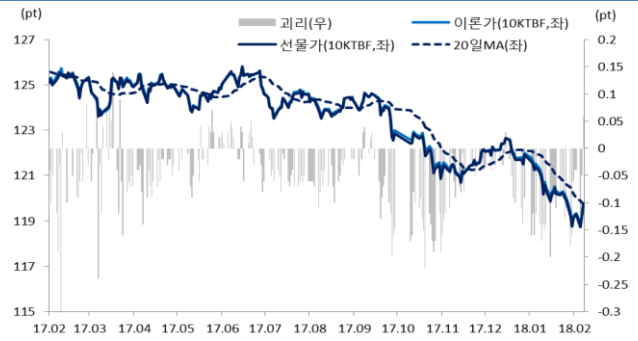
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



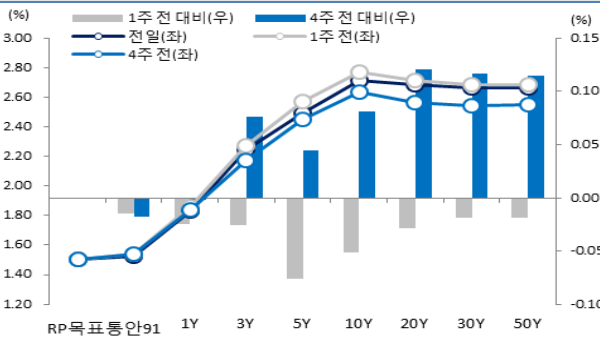
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



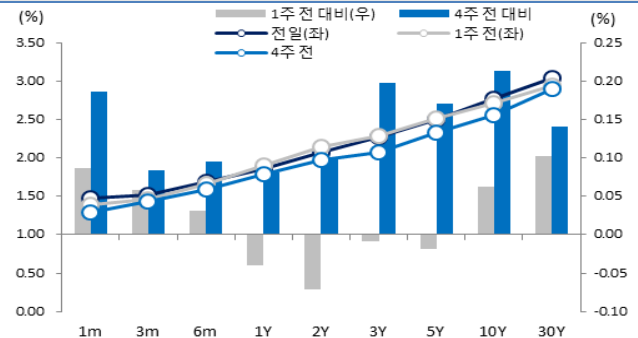
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 국채 수익률 곡선(한국)



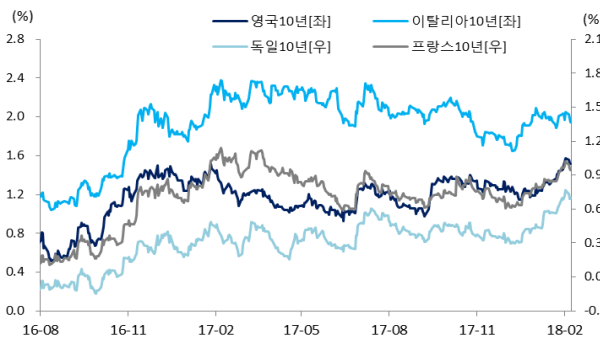
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 국채 수익률 곡선(미국)



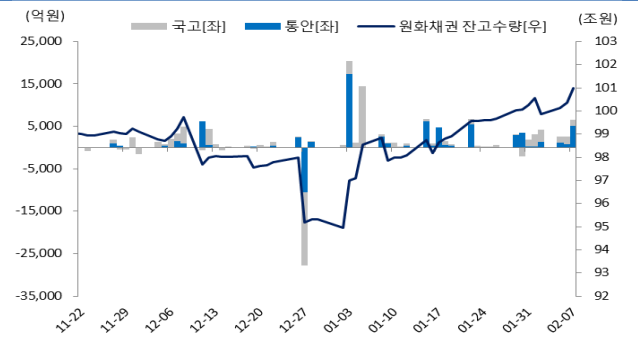
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 유럽 주요국 국채수익률



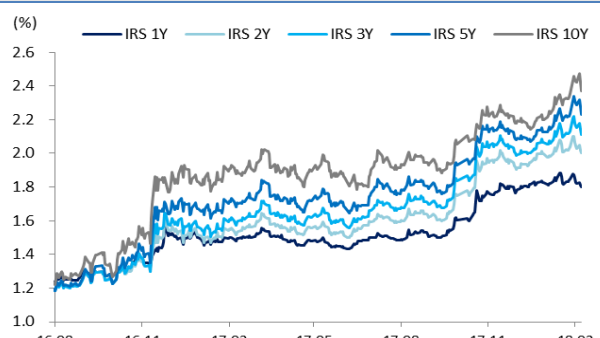
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 외국인 국고채 및 통안채 일별 거래내역



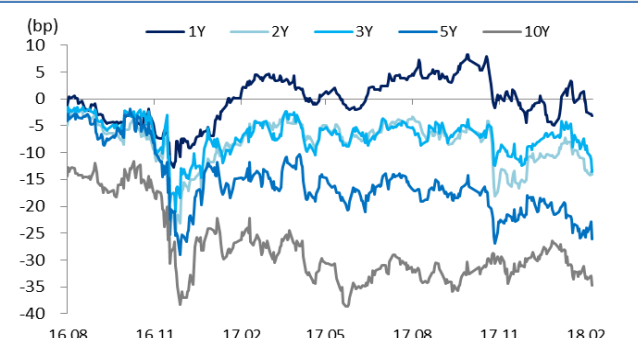
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS 금리



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. Swap Spread (IRS - 국고채)



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.