

KTB 선물 가격

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	수익률(%)	1 주 전	이론가	저평가	M.Dur	거래량	미결제약정
NKTB803	107.62	107.64	107.55	107.55	-0.03	2.378%	-0.02	107.62	-0.07	2.7971	71,560	234,312
NKTB806	107.42	107.42	107.42	107.42		2.421%		107.33	0.09	2.7964	0	0
10KTB803	119.50	119.56	119.22	119.22	-0.18	2.785%	-0.06	119.28	-0.06	8.0756	43,097	97,549
10KTB806	119.27	119.27	119.27	119.27		2.780%		118.96	0.31	8.0763	0	0

출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균 (5일, 10일, 20일, 60일)

	5일	10일	20일	60일
NKTB803	107.57	107.51	107.59	107.89
10KTB803	119.26	119.19	119.66	121.01
국고 3년	2.268	2.270	2.237	2.160
국고 5년	2.519	2.539	2.502	2.385
국고 10년	2.756	2.742	2.689	2.566

출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표 (PIVOT)

기술적 지표	NKTB803	10KTB803
2차 저항	107.67	119.67
1차 저항	107.61	119.45
PIVOT	107.58	119.33
1차 지지	107.52	119.11
2차 지지	107.49	118.99
디마크 High	107.60	119.39
Low	107.51	119.05

출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헷지비용

NKTB803	수익률	헷지비용	NKTB803	수익률	헷지비용	10KTB803	수익률	헷지비용	10KTB803	수익률	헷지비용
국고 16-7	2.173	58.62	국고 17-6	2.285	89.87	국고 17-3	2.767	82.33	국고 17-3	2.767	82.28
국고 17-2	2.262	74.44	국고 17-2	2.262	74.54	국고 16-8	2.758	76.39	국고 17-7	2.763	87.12
국고 17-4	2.533	140.98	국고 17-4	2.533	141.19						

출처: 금융투자협회, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

	금리	전일비	1주 대비	4주 대비
CD91일	1.650	0.000	0.000	-0.010
통안증권 1년	1.854	0.008	0.015	0.016
국고채권 1년	1.850	0.005	0.006	0.016
국고채권 3년	2.278	0.006	0.028	0.104
국고채권 5년	2.525	0.009	-0.010	0.095
국고채권 10년	2.757	0.013	0.001	0.134
국고채권 20년	2.730	0.020	0.027	0.170
국고채권 30년	2.698	0.025	0.009	0.160
국고채권 50년	2.696	0.021	0.007	0.158
회사채 AA- 3년	2.808	0.006	0.022	0.101
회사채 BBB- 3년	9.051	0.006	0.026	0.077

출처: 금융투자협회, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

	CRS		IRS		베이스스
	중간값	전일비	중간값	전일비	
1년	1.280	-0.050	1.825	0.000	-0.5450
2년	1.415	-0.035	2.038	0.003	-0.6225
3년	1.500	-0.035	2.153	0.003	-0.6525
4년	1.565	-0.035	2.225	0.003	-0.6600
5년	1.615	-0.035	2.280	0.005	-0.6650
7년	1.720	-0.035	2.343	0.005	-0.6225
10년	1.860	-0.035	2.428	0.005	-0.5675

출처: Tullet Prebon, NH선물 리서치센터

투자자별 순매수 동향(NKTB803)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험	개인
2월 9일	-2,590	7,232	-1,382	-3,555	511	43
2월 8일	-2,088	1,780	826	-1,069	369	-57
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
1주	-6,466	-3,664	-2,979	12,692	1,925	-7
2주	-3,231	18,849	-6,062	-8,719	1,380	-433
4주	-140	9,162	-6,556	3,935	573	-2,069
누적	53,637	-43,210	-24,855	8,289	1,743	17,089

출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

투자자별 순매수 동향(10KTB803)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험	개인
2월 9일	1,074	-265	-66	-276	-539	21
2월 8일	293	-648	369	315	-322	-30
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
1주	9,255	-6,972	-694	826	-1,779	-225
2주	9,988	-5,241	-223	-2,313	-572	-494
4주	14,021	-12,178	763	-4,404	-270	1,543
누적	8,102	-8,604	-7,900	1,622	-3,699	9,053

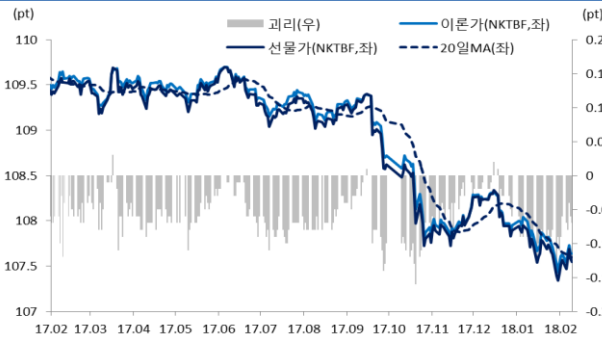
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

전일 해외시장 동향

종목	전일증가(%)	전일비(bp)	종목	전일증가(%)	전일비(bp)	종목	전일증가(%)	전일비(bp)
UST2Y	2.0732	-3.02	UST10Y	2.8512	2.72	UST30Y	3.1596	3.03

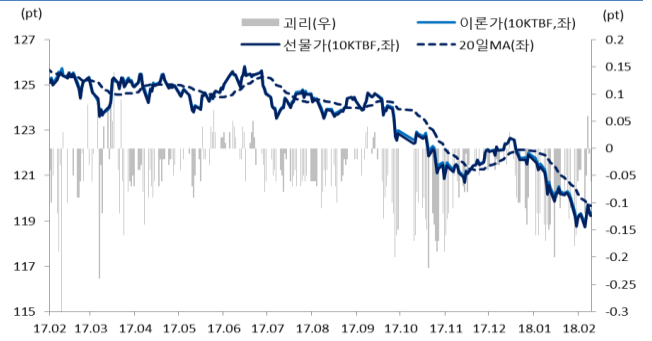
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



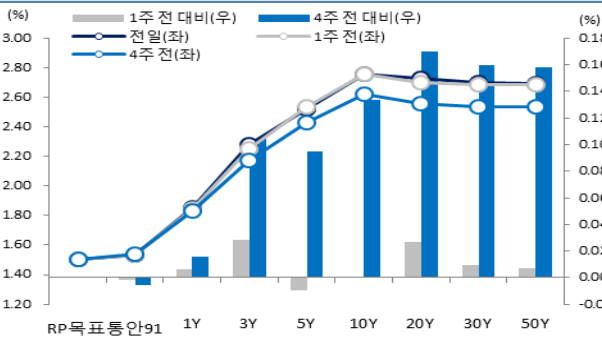
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



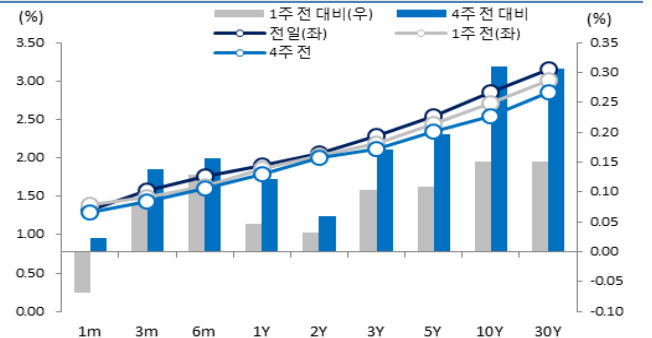
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 국채 수익률 곡선(한국)



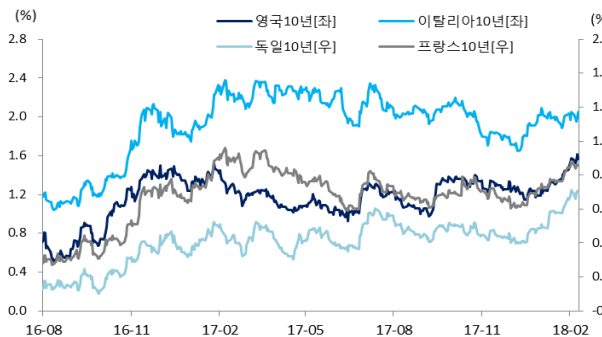
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 국채 수익률 곡선(미국)



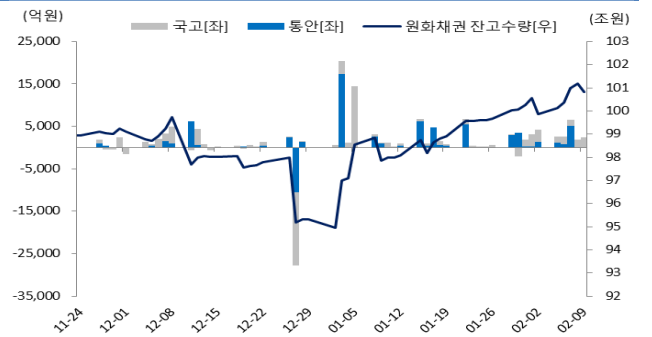
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 유럽 주요국 국채수익률



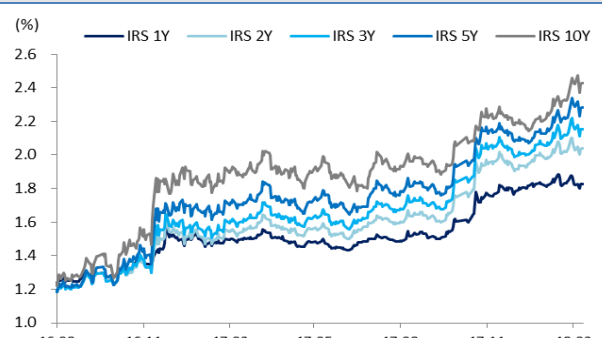
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 외국인 국고채 및 통안채 일별 거래내역



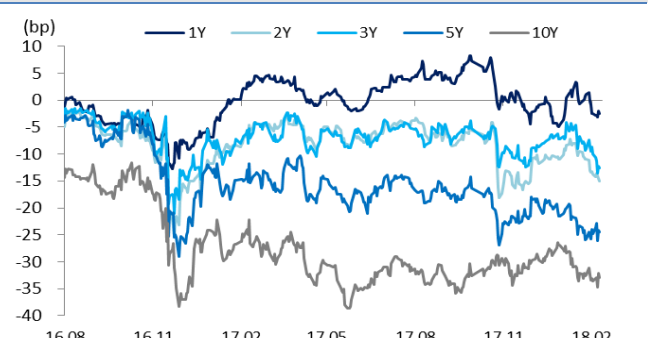
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

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.