

KTB 선물 가격

종목	시가	고가	저가	종가	전일비	수익률(%)	1 주 전	이론가	저평가	M.Dur	거래량	미결제약정
NKTB803	107.51	107.60	107.49	107.60	0.13	2.361%	0.02	107.66	-0.06	2.7974	62,767	236,376
NKTB806	107.31	107.31	107.31	107.31		2.457%		107.36	-0.05	2.7958		
10KTB803	118.95	119.21	118.84	119.15	0.35	2.792%	-0.05	119.17	-0.02	8.0747	38,103	97,476
10KTB806	118.78	118.78	118.78	118.78		2.831%		118.84	-0.06	8.0699		

출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균 (5일, 10일, 20일, 60일)

	5일	10일	20일	60일
NKTB803	107.58	107.55	107.59	107.88
10KTB803	119.26	119.19	119.56	120.94
국고 3년	2.276	2.269	2.244	2.164
국고 5년	2.528	2.535	2.510	2.391
국고 10년	2.754	2.758	2.703	2.571

출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표 (PIVOT)

기술적 지표	NKTB803	10KTB803
2차 저항	107.67	119.44
1차 저항	107.64	119.29
PIVOT	107.56	119.07
1차 지지	107.53	118.92
2차 지지	107.45	118.70
디마크 High	107.66	119.37
Low	107.55	119.00

출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헷지비용

NKTB803	수익률	헷지비용	NKTB803	수익률	헷지비용	10KTB803	수익률	헷지비용	10KTB803	수익률	헷지비용
국고 16-7	2.158	58.44	국고 17-6	2.274	89.85	국고 17-3	2.780	82.24	국고 17-3	2.780	82.55
국고 17-2	2.249	74.25	국고 17-2	2.249	74.49	국고 16-8	2.774	76.29	국고 17-7	2.779	87.37
국고 17-4	2.540	140.70	국고 17-4	2.540	141.16						

출처: 금융투자협회, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이

	금리	전일비	1주 대비	4주 대비
CD91일	1.650	0.000	0.000	-0.010
통안증권 1년	1.860	-0.009	0.027	0.007
국고채권 1년	1.852	-0.007	0.012	0.001
국고채권 3년	2.278	-0.024	0.025	0.053
국고채권 5년	2.541	-0.025	0.037	0.073
국고채권 10년	2.780	-0.026	0.031	0.139
국고채권 20년	2.735	-0.020	0.026	0.163
국고채권 30년	2.701	-0.013	0.021	0.161
국고채권 50년	2.702	-0.015	0.017	0.162
회사채 AA- 3년	2.816	-0.019	0.028	0.071
회사채 BBB- 3년	9.053	-0.023	0.026	0.045

출처: 금융투자협회, NH선물 리서치센터

CRS/IRS

	CRS		IRS		베이스스
	중간값	전일비	중간값	전일비	
1년	1.270	-0.005	1.820	-0.013	-0.5500
2년	1.395	-0.020	2.033	-0.023	-0.6375
3년	1.495	-0.015	2.148	-0.028	-0.6525
4년	1.570	-0.010	2.228	-0.028	-0.6575
5년	1.625	-0.005	2.288	-0.025	-0.6625
7년	1.730	-0.005	2.355	-0.025	-0.6250
10년	1.880	-0.005	2.445	-0.030	-0.5650

출처: Tullet Prebon, NH선물 리서치센터

투자자별 순매수 동향(NKTB803)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험	개인
2월 13일	1,670	4,283	-517	-4,350	-27	-78
2월 12일	-1,178	1,209	-1,926	1,476	52	100
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
1주	-2,281	11,770	-2,846	-7,625	1,637	12
2주	-11,630	23,848	-9,950	1,707	208	-200
4주	7,245	14,380	-9,789	-5,531	269	-1,010
누적	54,129	-37,718	-27,298	5,415	1,768	17,111

출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

투자자별 순매수 동향(10KTB803)

일자	외국인	금융투자	투신	은행	보험	개인
2월 13일	2,037	-1,153	-28	-297	-431	54
2월 12일	1,418	-107	25	-1,345	-111	17
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
1주	7,009	-3,084	-61	-1,641	-1,608	-97
2주	10,718	-642	-787	-637	-1,914	-671
4주	15,303	-14,369	-139	-1,303	-1,255	1,430
누적	11,557	-9,864	-7,903	-20	-4,241	9,124

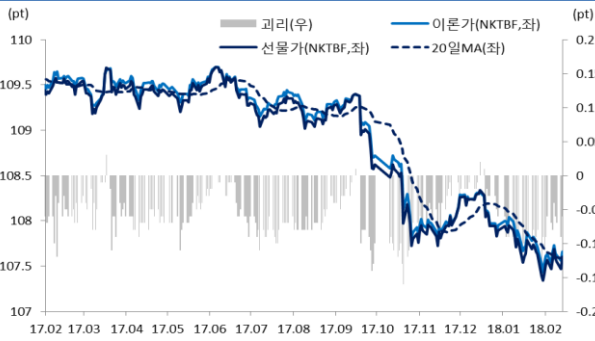
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

전일 해외시장 동향

종목	전일증가(%)	전일비(bp)	종목	전일증가(%)	전일비(bp)	종목	전일증가(%)	전일비(bp)
UST2Y	2.1040	2.87	UST10Y	2.8294	-2.91	UST30Y	3.1111	-3.28

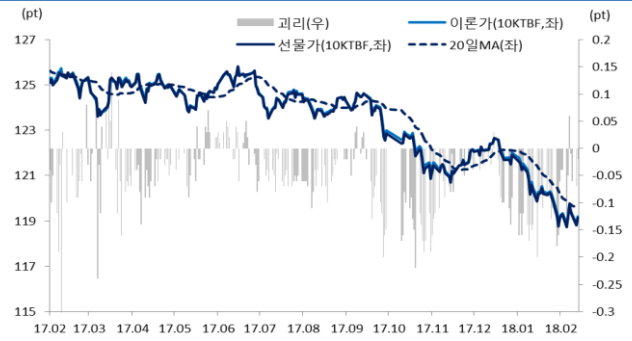
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. NKTB 선물가 및 이론가



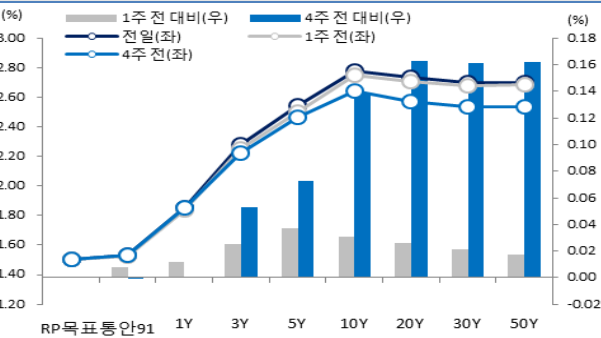
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 10KTB 선물가 및 이론가



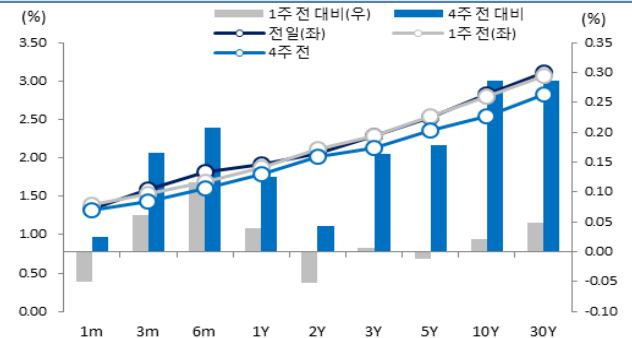
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 국채 수익률 곡선(한국)



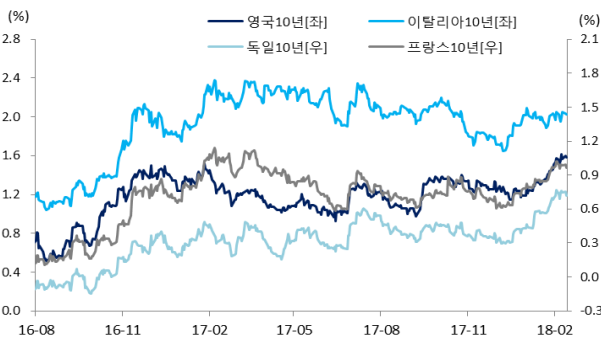
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 국채 수익률 곡선(미국)



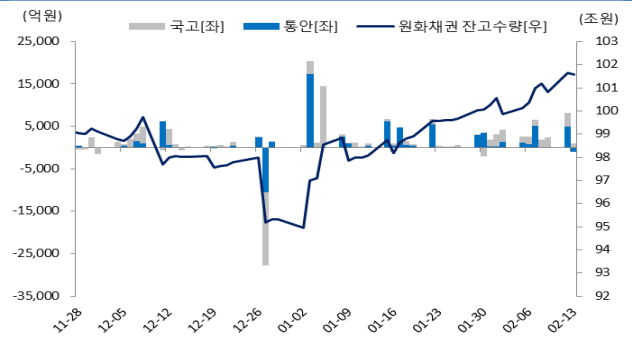
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 유럽 주요국 국채수익률



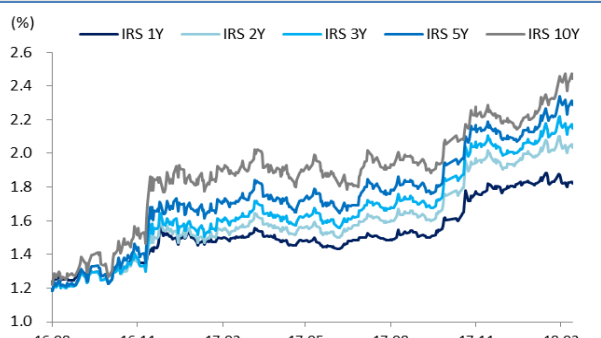
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 외국인 국고채 및 통안채 일별 거래내역



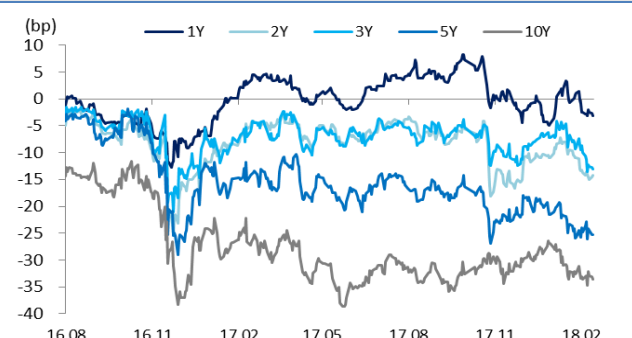
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

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.