

\* 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   |
|----------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|-------|-------|---------|---------|
| NKTB003  | 110.26 | 110.27 | 110.14 | 110.20 | -0.10 | 1.510% | 110.23 | -0.03 | 2.81  | 132,443 | 286,050 |
| NKTB006  | 110.29 | 110.29 | 110.29 | 110.29 | -0.01 | 1.481% | 110.21 | 0.08  | 2.81  | -       | 3       |
| 10KTB003 | 129.26 | 129.43 | 129.03 | 129.38 | -0.09 | 1.780% | 129.32 | 0.06  | 8.20  | 71,305  | 135,813 |
| 10KTB006 | 129.53 | 129.53 | 129.53 | 129.53 | -0.29 | 1.766% | 129.31 | 0.22  | 8.20  | -       | 1       |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

이동평균선 (단위 : %, pt)

|          | 이동평균선  |        |        |        |
|----------|--------|--------|--------|--------|
|          | 5MA    | 10MA   | 20MA   | 60MA   |
| NKTB003  | 110.34 | 110.37 | 110.47 | 110.30 |
| 10KTB003 | 129.63 | 129.74 | 130.18 | 130.03 |
| KT3Y     | 1.418  | 1.404  | 1.376  | 1.430  |
| KT5Y     | 1.537  | 1.518  | 1.481  | 1.531  |
| KT10Y    | 1.723  | 1.698  | 1.668  | 1.698  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

기술적 지표 (단위 : %, 계약)

|             | NKTB003 | 10KTB003 |
|-------------|---------|----------|
| 2차저항        | 110.33  | 129.68   |
| 1차저항        | 110.27  | 129.53   |
| PIVOT       | 110.20  | 129.28   |
| 1차지지        | 110.14  | 129.13   |
| 2차지지        | 110.07  | 128.88   |
| Demark High | 110.24  | 129.61   |
| Demark Low  | 110.11  | 129.21   |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Basket 수익률과 헷지비율 (단위 : %, 계약)

| NKTB003 | 수익률   | 헷지비율   | NKTB006 | 수익률   | 헷지비율   | 10KTB003 | 수익률   | 헷지비율  | 10KTB006 | 수익률   | 헷지비율  |
|---------|-------|--------|---------|-------|--------|----------|-------|-------|----------|-------|-------|
| 국고 18-9 | 1.443 | 60.21  | 국고 19-3 | 1.461 | 75.49  | 국고 18-10 | 1.778 | 79.24 | 국고 19-4  | 1.778 | 81.41 |
| 국고 19-3 | 1.461 | 75.57  | 국고 19-5 | 1.583 | 142.83 | 국고 19-4  | 1.778 | 81.52 | 국고 19-8  | 1.763 | 83.39 |
| 국고 19-5 | 1.583 | 142.97 | 국고 19-7 | 1.456 | 90.47  |          |       |       |          |       |       |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

현물 금리 추이 (단위 : %, %p)

|       | 금리    | 전일비   | 1주대비  | 4주대비   |
|-------|-------|-------|-------|--------|
| CD91일 | 1.460 | 0.000 | 0.000 | -0.070 |
| 통안1년  | 1.384 | 0.020 | 0.035 | -0.001 |
| 국고1년  | 1.355 | 0.014 | 0.027 | 0.013  |
| 국고3년  | 1.455 | 0.022 | 0.037 | 0.075  |
| 국고5년  | 1.583 | 0.030 | 0.033 | 0.121  |
| 국고10년 | 1.762 | 0.021 | 0.033 | 0.120  |
| 국고20년 | 1.759 | 0.036 | 0.042 | 0.116  |
| 국고30년 | 1.716 | 0.040 | 0.047 | 0.103  |
| 국고50년 | 1.719 | 0.044 | 0.051 | 0.108  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS/IRS (단위 : %, %p)

|     | CRS   |       | IRS   |       | CRS-IRS |
|-----|-------|-------|-------|-------|---------|
|     | 중간값   | 전일비   | 중간값   | 전일비   | Basis   |
| 1년  | 0.870 | 0.020 | 1.420 | 0.008 | -0.550  |
| 2년  | 0.810 | 0.020 | 1.423 | 0.015 | -0.613  |
| 3년  | 0.845 | 0.025 | 1.440 | 0.023 | -0.595  |
| 4년  | 0.860 | 0.025 | 1.458 | 0.025 | -0.598  |
| 5년  | 0.865 | 0.025 | 1.468 | 0.025 | -0.603  |
| 7년  | 0.900 | 0.010 | 1.478 | 0.030 | -0.578  |
| 10년 | 0.950 | 0.010 | 1.513 | 0.035 | -0.563  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

NKTB 투자자별 매매동향 (단위 : 계약)

| 일자     | 외국인     | 금융투자     | 투신      | 은행     | 보험     |
|--------|---------|----------|---------|--------|--------|
| 1월 20일 | -1,241  | -8,654   | 1,731   | 6,238  | 173    |
| 1월 17일 | -12,248 | 15,975   | 1,408   | -6,438 | 339    |
| 1월 16일 | -136    | -6,038   | -1,083  | 7,521  | -200   |
| 1월 15일 | 2,582   | -2,105   | -1,701  | 2,840  | -858   |
| 1월 14일 | -2,048  | 9,620    | -1,522  | -4,648 | 115    |
| 1주     | -13,091 | 8,798    | -1,167  | 5,513  | -431   |
| 2주     | -12,977 | -14,474  | 4,691   | 17,236 | 283    |
| 4주     | 16,426  | -27,978  | 4,709   | -188   | -699   |
| 누적     | 137,637 | -134,026 | -10,816 | -5,596 | -2,613 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

10KTB 투자자별 매매동향 (단위 : 계약)

| 일자     | 외국인    | 금융투자    | 투신    | 은행     | 보험     |
|--------|--------|---------|-------|--------|--------|
| 1월 20일 | 3,233  | -6,016  | 243   | 1,711  | 395    |
| 1월 17일 | 2,317  | -3,316  | -727  | 2,071  | -206   |
| 1월 16일 | 5,074  | -4,698  | -106  | -495   | 358    |
| 1월 15일 | -791   | 1,282   | 942   | -1,929 | 286    |
| 1월 14일 | -3,317 | 1,626   | 1,624 | -900   | 679    |
| 1주     | 6,516  | -11,122 | 1,976 | 458    | 1,512  |
| 2주     | 373    | -6,635  | 2,304 | -1,636 | 2,422  |
| 4주     | -1,578 | -7,857  | 2,550 | 3,907  | 1,376  |
| 누적     | -2,831 | -274    | 1,575 | -5,942 | -2,327 |

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 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.