

금일 예상 Range
 KTB : 109.13 ~ 109.37
 LTB : 127.27 ~ 127.69

미국 휴장 . 글로벌 동향 이슈

Jan 02, 2019.

Analyst 정성윤 02.788.7064

yunikong@hifutures.co.kr

Equities

	증가 (p)	전일비 (p)	등락률 (%)
KOSPI	2,041.04	▲ 0.00	0.00
KOSDAQ	675.65	▲ 0.00	0.00
DOW	23,327.46	▲ 265.06	1.15
NASDAQ	6,635.28	▲ 50.76	0.77
S&P 500	2,506.85	▲ 21.11	0.85
SHANGHAI	2,493.90	▲ 0.00	0.00
NIKKEI 225	20,014.77	▲ 0.00	0.00
HANGSENG	25,845.70	▲ 341.50	1.34
HSCEI	10,124.75	▲ 132.53	1.33
FTSE 100	6,728.13	▼ -5.84	-0.09
DAX 30	10,558.96	▲ 0.00	0.00

FX Rates

	증가	전일비	등락률 (%)
USD/KRW	1,115.70	▼ -0.30	-0.03
USD/JPY	110.08	▼ -0.36	-0.32
EUR/USD	1.1433	▼ -0.0024	-0.21
GBP/USD	1.2730	▲ 0.0078	0.62

Treasury Yields

	증가 (%)	전일비 (%p)
KTB 3Y	1.817	▲ 0.000
KTB 10Y	1.948	▲ 0.000
JGB 10Y	0.000	▲ 0.000
UST 2Y	2.504	▼ -0.028
UST 10Y	2.685	▼ -0.033
Bund 10Y	0.243	▲ 0.000

▶ 신년 휴장 . 국채금리 소폭 하락

국내 국채선물 시장은 신년 휴장.

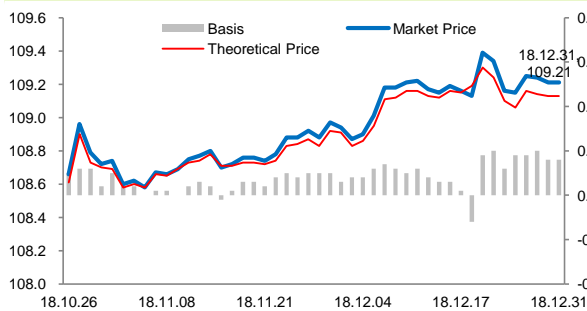
▶ 뉴욕채권 : New Year's Day 휴장

미국 금융시장은 New Year's Day 휴장. 12월 31일, 29일 주말 시 주석과 통화후 트럼프 트위터 통해 '중국과의 대화에서 큰 진전' 을 보임. 섣다른 등 불확실성 속에서 미 상원, 전일 회의 개최.

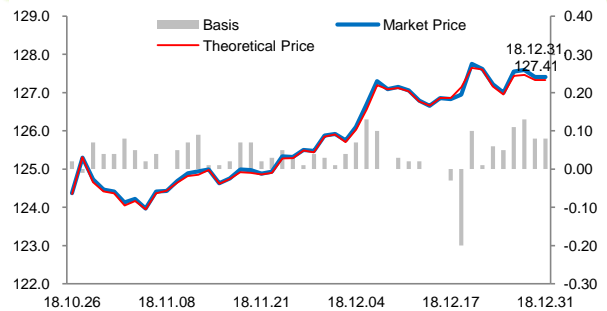
▶ 미국 휴장 . 글로벌 동향 이슈

미국 뉴욕 증시는 연말 마지막 장을 상승으로 마감. 다만 신년휴일을 앞둔 거래량 부진으로 변동성은 다소 제한된 모습으로 마무리. 연방 섣다른 이슈는 현재진행형임. 지난주 목요일 민주당의 하원 다수당 장악을 앞두고 양측은 멕시코 국경장벽 건설 예산을 두고 긴장감이 고조. 시장은 민주당이 하원에서 연방정부 섣다른 중지를 위한 예산안을 가결하더라도 트럼프와 상원이 이를 거절하는 시나리오에 무게를 실는 모습. 이는 미국의 정치적 내홍이 새해에도 불확실성의 연장선상에 놓여있을것이란 우려를 자극하는 요인. 국내 국채선물 시장은 연말 특별한 이슈는 부재했던 가운데 거래량도 크지 않음. 이러한 움직임은 연초까지 이어져 보험세를 나타낼것으로 예상.

[KTB Futures & Theoretical Basis]



[LTB Futures & Theoretical Basis]



[주요 경제지표 및 이벤트]

	국내	국외
전일		
금일		

KTB Futures Market

종목	시가	고가	저가	종가	전일대비	거래량	미결제약정	M.Duration	Convexity	이론가	저평가
KTB 1709	109.28	109.29	109.19	109.21	0.00	40,269	324,709	2.81	4.77	109.13	0.08
LTB 1709	127.61	127.66	127.34	127.41	0.00	41,225	97,081	8.18	39.61	127.33	0.08

Swap Market

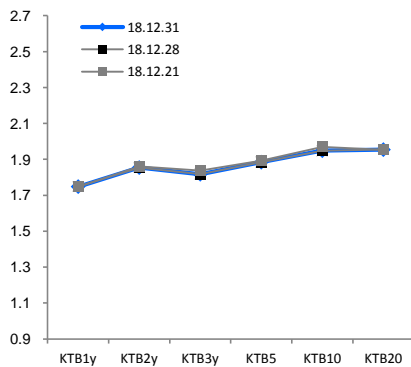
IRS	1Y	2Y	3Y	5Y	10Y	CRS	1Y	2Y	3Y	5Y	10Y
18.10.04	1.8775	1.9950	2.0500	2.1275	2.2375	18.10.04	1.4350	1.3550	1.3450	1.4150	1.6500
18.11.30	1.8925	1.8975	1.9050	1.9379	2.0350	18.11.30	1.2150	1.1800	1.1950	1.1600	1.4100
18.12.21	1.8775	1.8400	1.8100	1.8000	1.8500	18.12.21	1.1950	1.1450	1.1350	1.1000	1.3700
18.12.28	1.8750	1.8175	1.7850	1.7725	1.8300	18.12.28	1.2100	1.1400	1.1400	1.0850	1.4000
18.12.31	1.8750	1.8175	1.7850	1.7725	1.8300	18.12.31	1.2100	1.1400	1.1400	1.0850	1.4000

Spread & Curve

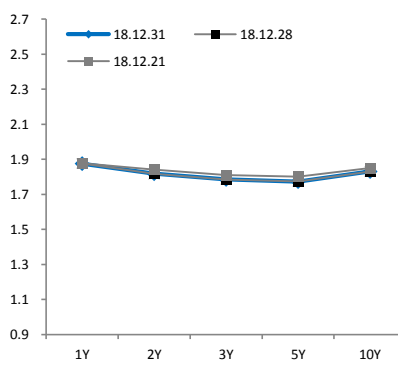
Swap Spread	1Y	2Y	3Y	5Y	10Y	Basis Swap	1Y	2Y	3Y	5Y	10Y
18.10.04	0.013	-0.043	-0.016	-0.115	-0.208	18.10.04	-0.443	-0.640	-0.705	-0.713	-0.588
18.11.30	0.063	-0.023	0.008	-0.034	-0.071	18.11.30	-0.678	-0.718	-0.710	-0.778	-0.625
18.12.21	0.132	-0.020	-0.028	-0.093	-0.120	18.12.21	-0.683	-0.695	-0.675	-0.700	-0.480
18.12.28	0.127	-0.037	-0.032	-0.112	-0.118	18.12.28	-0.665	-0.678	-0.645	-0.688	-0.430
18.12.31	0.127	-0.037	-0.032	-0.112	-0.118	18.12.31	-0.665	-0.678	-0.645	-0.688	-0.430

KTB	KTB1y	KTB2y	KTB3y	KTB5	KTB10	CRS-KTB	1Y	2Y	3Y	5Y	10Y
18.10.04	1.864	2.038	2.066	2.242	2.445	18.10.04	-0.429	-0.683	-0.721	-0.827	-0.795
18.11.30	1.830	1.920	1.897	1.972	2.106	18.11.30	-0.615	-0.740	-0.702	-0.812	-0.696
18.12.21	1.746	1.860	1.838	1.893	1.970	18.12.21	-0.551	-0.715	-0.703	-0.793	-0.600
18.12.28	1.748	1.854	1.817	1.884	1.948	18.12.28	-0.538	-0.714	-0.677	-0.799	-0.548
18.12.31	1.748	1.854	1.817	1.884	1.948	18.12.31	-0.538	-0.714	-0.677	-0.799	-0.548

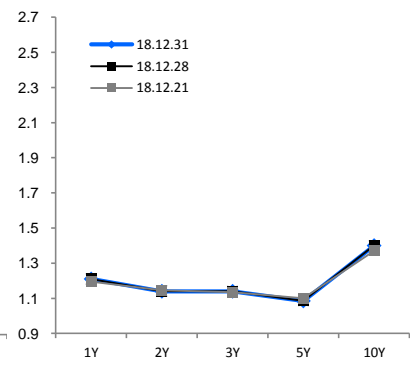
[Yield Curve]



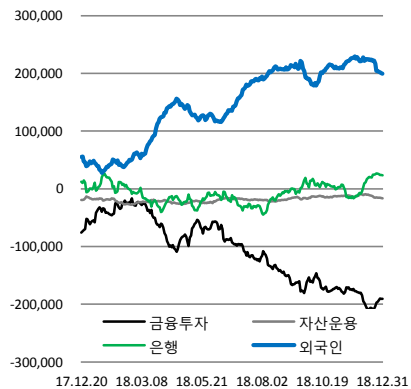
[IRS Curve]



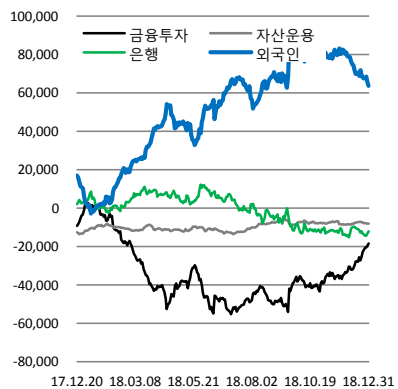
[CRS Curve]



[Investors' Activities (KTB Futures)]



[Investors' Activities (LTB Futures)]



[Treasury Notes Yields]

