IPS Daily Morning Brief

2018-12-26

종가 기준일 2018-12-21

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8975	0.00	1.8955	1.8715	1.8080	1.9050	1.4100	2.3575	1.2875
9M	1.8850	0.50	1.8800	1.8699	1.8348	1.9125	1.4500	2.3550	1.2500
1Y	1.8775	1.75	1.8615	1.8653	1.8533	1.9200	1.4875	2.3600	1.2200
1.5Y	1.8700	2.75	1.8440	1.8621	1.8802	2.0250	1.5500	2.3900	1.1900
2Y	1.8400	2.75	1.8185	1.8523	1.8978	2.1150	1.5975	2.4250	1.1675
3Y	1.8100	4.00	1.7820	1.8379	1.9193	2.2225	1.6750	2.5200	1.1550
4Y	1.8050	4.00	1.7780	1.8421	1.9440	2.2950	1.7250	2.6075	1.1575
5Y	1.8000	4.25	1.7745	1.8483	1.9652	2.3400	1.7400	2.6700	1.1575
7Y	1.8050	4.25	1.7830	1.8641	1.9934	2.3950	1.7475	2.7775	1.1675
10Y	1.8500	4.00	1.8310	1.9184	2.0544	2.4850	1.7950	2.9050	1.2125
12Y	1.8725	4.00	1.8535	1.9425	2.0834	2.5225	1.8175	2.9575	1.2150
15Y	1.8800	4.00	1.8610	1.9493	2.0887	2.5400	1.8250	3.0100	1.2150
20Y	1.8375	4.00	1.8255	1.9313	2.0841	2.5600	1.7875	3.1300	1.2150

6*9M	-1.25	0.50	-1.55	-0.16	2.68	12.50	-1.75	12.50	-6.00
9*12M	-0.75	1.25	-1.85	-0.46	1.84	10.50	-2.50	10.50	-4.25
1*2Y	-3.75	1.00	-4.30	-1.30	4.45	23.00	-5.50	23.00	-5.50
2*3Y	-3.00	1.25	-3.65	-1.44	2.15	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-3.50	1.25	-4.05	-1.01	4.62	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-4.00	1.50	-4.40	-0.40	6.74	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.50	0.00	-0.40	0.43	2.46	8.50	-0.75	11.25	-0.75
3*5Y	-1.00	0.25	-0.75	1.04	4.59	14.00	-1.25	22.00	-1.25
4*5Y	-0.50	0.25	-0.35	0.61	2.13	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	0.50	0.00	0.85	1.59	2.82	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.00	-0.25	5.65	7.01	8.92	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.50	-0.25	4.80	5.43	6.10	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.25	0.00	2.25	2.41	2.90	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.00	3.00	3.09	3.43	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	-1.25	0.00	-0.55	1.29	2.97	10.25	-1.25	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.823	1.90	1.813	1.851	1.876	1.935	1.400	2.368	1.237
1.5Y	1.866	1.70	1.858	1.890	1.928	2.113	1.542	2.405	1.232
2Y	1.865	3.30	1.839	1.878	1.943	2.230	1.637	2.460	1.225
3Y	1.842	4.20	1.801	1.843	1.937	2.315	1.736	2.540	1.200
4Y	1.904	4.20	1.876	1.924	2.034	2.502	1.849	2.705	1.232
5Y	1.902	5.60	1.862	1.919	2.056	2.602	1.825	2.767	1.217
7Y	1.976	4.80	1.947	1.995	2.146	2.728	1.913	2.945	1.270
10Y	1.975	4.10	1.961	2.036	2.208	2.815	1.923	3.097	1.355
20Y	1.960	3.50	1.943	2.002	2.163	2.792	1.910	3.270	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.90	0.00
CALL	1.79	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.16	-0.18	109.30	109.31	109.16
LKTB	127.22	-0.40	127.45	127.57	127.21

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	5.45	-0.15	4.81	1.42	-2.27	9.00	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	0.40	1.05	-1.44	-2.78	-4.75	0.80	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-2.50	-0.55	-2.03	-2.61	-4.49	-0.25	-18.30	1.80	-25.15
3Y	-3.20	-0.20	-1.88	-0.55	-1.79	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-9.90	-0.20	-9.80	-8.19	-9.04	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.20	-1.35	-8.75	-7.09	-9.07	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.10	-0.55	-16.38	-13.06	-15.30	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-12.50	-0.10	-12.98	-11.76	-15.35	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-12.25	0.50	-11.77	-7.09	-7.86	1.75	-36.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-68.25	-0.75
-72.50	-1.25
-69.50	-0.75
-67.50	-2.00
-67.50	-2.00
-70.00	-2.25
-61.00	-2.25
-48.00	-2.00

CRS

USD/KRW 1122.40 (-5.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1950	1.00	1.6200	0.8800	1*2Y	-5.00	1.00
1.5Y	1.1450	1.50	1.6600	0.9050	2*3Y	-1.00	0.00
2Y	1.1450	2.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-4.50	0.00
3Y	1.1350	2.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	1.1300	2.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-3.50	0.00
5Y	1.1000	2.00	1.8500	1.0400	4*5Y	-3.00	0.00
7Y	1.1950	2.00	1.8950	1.0950	5*7Y	9.50	0.00
10Y	1.3700	2.00	2.0500	1.2600	5*10Y	27.00	0.00

U.S. TREASURY

(한국 영업일 기준 전일비)

Tenor	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
2Y	2.6327	-0.0420	2.6747	2.6376	2.6460	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7825	-0.0262	2.8087	2.7775	2.8187	3.2382	2.0387	3.2382	1.3600

U.S. TREASURY - KTB

(한국 영업일 기준 전일비)

Tenor	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
2Y	76.77	-7.5	84.27	82.26	81.10	103.03	-53.43	103.03	-195.50
10Y	80.75	-6.72	87.47	85.45	84.87	98.82	-24.46	98.82	-72.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	1.00	1.25	-0.25	0.25	2.25	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTB 2*10Y	11.00	0.80	10.20	10.80	13.50	63.50	10.20	82.90	10.20
UST 2*10Y	14.98	1.58	13.40	13.99	17.27	92.41	8.46	205.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	89.5	ODD Tenor	
09M	88.5		
01Y	87.5		
1.5Y			
02Y		SPRD	6*9*12m fly 00
03Y			
04Y			
05Y			
07Y			
10Y			
12Y	88		
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	86 건	-19	105	81	78	56	96	91
금 액	27,885 억원	-6,547	34,432	19,866	18,615	13,059	20,223	40,615

장중동향

국고채 금리 상승.

국채선물은 외국인의 매도속에 3년물이 약보합으로 마감했고 10년선물은 약세를 보이면서 금리커브 스팁 마감.

IRS는 금리 상승, 커브 스팁 마감.

크리스마스를 앞두고 연말분위기에 한산 국채선물과 연동해 움직임.

CRS는 전구간 상승.