IPS Daily Morning Brief

2018-12-07

종가 기준일 2018-12-06

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8900	-1.00	1.8985	1.8069	1.7818	1.9050	1.4025	2.4375	1.2875
9M	1.8800	-2.25	1.8995	1.8318	1.8210	1.9125	1.4425	2.4300	1.2500
1Y	1.8825	-2.75	1.9045	1.8470	1.8490	1.9200	1.4825	2.4300	1.2200
1.5Y	1.8775	-3.25	1.9080	1.8643	1.8874	2.0250	1.5400	2.4525	1.1900
2Y	1.8550	-4.25	1.9025	1.8766	1.9151	2.1150	1.5875	2.4850	1.1675
3Y	1.8325	-5.75	1.8985	1.8955	1.9515	2.2225	1.6600	2.5800	1.1550
4Y	1.8250	-6.00	1.9030	1.9179	1.9845	2.2950	1.7100	2.6625	1.1575
5Y	1.8350	-4.50	1.9085	1.9359	2.0109	2.3400	1.7550	2.7250	1.1575
7Y	1.8350	-4.75	1.9250	1.9636	2.0448	2.3950	1.8075	2.8200	1.1675
10Y	1.8750	-5.50	1.9800	2.0254	2.1093	2.4850	1.8750	2.9475	1.2125
12Y	1.8950	-6.00	2.0060	2.0544	2.1418	2.5225	1.8950	2.9975	1.2150
15Y	1.8950	-6.25	2.0095	2.0604	2.1483	2.5400	1.8950	3.0475	1.2150
20Y	1.8825	-6.50	1.9995	2.0550	2.1495	2.5600	1.8825	3.1675	1.2150

6*9M	-1.00	-1.25	0.10	2.49	3.92	12.50	-1.00	12.50	-6.00
9*12M	0.25	-0.50	0.50	1.53	2.81	10.50	0.00	10.50	-4.25
1*2Y	-2.75	-1.50	-0.20	2.96	6.61	23.00	-2.75	23.00	-5.50
2*3Y	-2.25	-1.50	-0.40	1.89	3.64	13.25	-2.25	13.25	-2.25
2*4Y	-3.00	-1.75	0.05	4.13	6.94	21.75	-3.00	23.50	-3.00
2*5Y	-2.00	-0.25	0.60	5.93	9.58	27.25	-2.00	34.00	-2.00
3*4Y	-0.75	-0.25	0.45	2.24	3.30	8.50	-0.75	11.25	-0.75
3*5Y	0.25	1.25	1.00	4.04	5.94	14.00	-1.00	22.00	-1.00
4*5Y	1.00	1.50	0.55	1.80	2.64	6.00	-0.50	10.75	-0.50
5*7Y	0.00	-0.25	1.65	2.78	3.39	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	4.00	-1.00	7.15	8.95	9.84	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.00	-0.75	5.50	6.18	6.45	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.00	-0.50	2.60	2.90	3.25	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	2.00	-0.75	2.95	3.50	3.90	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	0.75	-1.00	1.95	2.96	4.03	10.25	0.75	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.870	-1.00	1.876	1.881	1.883	1.935	1.400	2.375	1.237
1.5Y	1.884	-3.10	1.912	1.924	1.939	2.113	1.523	2.445	1.232
2Y	1.861	-5.40	1.914	1.932	1.965	2.230	1.625	2.492	1.225
3Y	1.837	-5.30	1.890	1.919	1.974	2.315	1.707	2.585	1.200
4Y	1.889	-4.30	1.954	2.004	2.082	2.502	1.830	2.767	1.232
5Y	1.880	-4.50	1.949	2.012	2.113	2.602	1.880	2.830	1.217
7Y	1.938	-4.80	2.016	2.095	2.210	2.728	1.938	2.996	1.270
10Y	1.982	-5.30	2.069	2.160	2.280	2.815	1.982	3.148	1.355
20Y	1.940	-6.60	2.021	2.113	2.234	2.792	1.940	3.327	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.90	0.00
CALL	1.71	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.18	0.17	108.98	109.20	108.98
LKTB	127.30	0.61	126.60	127.39	126.57

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	1.25	-1.75	2.89	-3.40	-3.39	9.00	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-0.65	-0.15	-0.44	-5.93	-5.18	2.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-0.60	1.15	-1.17	-5.58	-4.99	-0.30	-18.30	2.50	-25.15
3Y	-0.45	-0.45	0.83	-2.40	-2.25	2.05	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-6.40	-1.70	-5.14	-8.66	-9.79	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-4.50	0.00	-4.09	-7.60	-10.18	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-10.30	0.05	-9.08	-13.10	-16.52	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-10.70	-0.20	-8.92	-13.48	-17.11	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-5.75	0.10	-2.19	-5.80	-8.41	1.75	-36.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-67.75	0.25
-69.25	0.75
-67.50	1.75
-66.25	3.75
-68.50	3.50
-73.50	0.00
-67.50	0.25
-55.00	-1.50

CRS

USD/KRW 1120.30 (+6.20)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2050	-2.50	1.6200	0.8600	1*2Y	-2.50	0.00
1.5Y	1.1850	-2.50	1.6600	0.9050	2*3Y	-1.00	0.50
2Y	1.1800	-2.50	1.6950	0.9200	2*5Y	-8.00	-2.00
3Y	1.1700	-2.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-3.00	-0.50
4Y	1.1400	-2.50	1.8000	1.0700	3*5Y	-7.00	-2.50
5Y	1.1000	-4.50	1.8500	1.1000	4*5Y	-4.00	-2.00
7Y	1.1600	-4.50	1.8950	1.1600	5*7Y	6.00	0.00
10Y	1.3250	-7.00	2.0500	1.3250	5*10Y	22.50	-2.50

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	2.7702	-0.0570	2.8272	2.8028	2.8231	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.8887	-0.0231	2.9118	2.9163	2.9733	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	90.92	-0.3	91.22	86.58	88.51	103.03	-53.43	103.03	-207.00
10Y	90.67	2.99	87.68	82.43	84.63	98.82	-24.46	98.82	-76.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	2.00	-1.25	3.25	8.25	11.50	42.50	2.00	62.75	2.00
KTB 2*10Y	12.10	0.10	12.00	15.50	18.90	63.50	12.00	82.90	11.80
UST 2*10Y	11.85	3.39	8.46	11.35	15.02	95.16	8.46	205.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	89.75		
01Y	90.5 / 89.5 / 88		
1.5Y			
02Y		SPRD	2*7Y -02
03Y	82.5 / 87.5 / 87.25 / 87		3*5Y -0.5
04Y	88		3*7Y -01
05Y	86.25		5*10Y 4.5
07Y			6*10Y 04
10Y	92		7*10Y 4.25
12Y			10*12Y 2.5
15Y			10*15Y 2.75 / 2.5
20Y			10*20Y 1.5
CRS	1y CCS 21 2y CCS 28		

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	219 건	25	194	159	170	204	132	139
금 액	60,201 억원	17,465	42,736	51,351	59,470	72,185	45,287	55,220

장중동향

국고채 금리, 전 만기 국고채 금리가 연중 최저치 마감. 안전자산 선호 경향 뚜렷.

IRS, 전 구간에서 금리 큰 폭 하락. 커브 플래트닝.
3Y 구간을 중심으로 오퍼가 강하게 나오면서 장중 3Y이 7bp 가까이 빠지기도.
역외는 며칠동안 언와인딩성 오퍼가 꾸준히 유입.

CRS, 금리 하락. 커브 플래트닝.