IPS Daily Morning Brief

2018-12-11

종가 기준일 2018-12-10

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8825	-0.75	1.8935	1.8183	1.7865	1.9050	1.4025	2.4000	1.2875
9M	1.8700	-1.25	1.8890	1.8386	1.8238	1.9125	1.4425	2.4000	1.2500
1Y	1.8575	-2.25	1.8895	1.8513	1.8507	1.9200	1.4825	2.4050	1.2200
1.5Y	1.8425	-2.75	1.8850	1.8646	1.8875	2.0250	1.5400	2.4400	1.1900
2Y	1.8175	-3.25	1.8695	1.8724	1.9136	2.1150	1.5875	2.4850	1.1675
3Y	1.7900	-2.75	1.8515	1.8848	1.9477	2.2225	1.6600	2.5800	1.1550
4Y	1.7850	-3.00	1.8485	1.9038	1.9794	2.2950	1.7100	2.6625	1.1575
5Y	1.7900	-3.00	1.8510	1.9198	2.0050	2.3400	1.7550	2.7250	1.1575
7Y	1.7975	-2.75	1.8585	1.9450	2.0377	2.3950	1.7975	2.8200	1.1675
10Y	1.8425	-3.25	1.9065	2.0053	2.1016	2.4850	1.8425	2.9475	1.2125
12Y	1.8625	-3.25	1.9285	2.0333	2.1334	2.5225	1.8625	2.9975	1.2150
15Y	1.8650	-3.00	1.9305	2.0391	2.1395	2.5400	1.8650	3.0475	1.2150
20Y	1.8525	-3.00	1.9190	2.0319	2.1401	2.5600	1.8525	3.1675	1.2150

6*9M	-1.25	-0.50	-0.45	2.04	3.73	12.50	-1.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.25	-1.00	0.05	1.26	2.69	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	-4.00	-1.00	-2.00	2.11	6.29	23.00	-4.00	23.00	-5.50
2*3Y	-2.75	0.50	-1.80	1.24	3.41	13.25	-3.25	13.25	-3.25
2*4Y	-3.25	0.25	-2.10	3.14	6.58	21.75	-3.50	23.50	-3.50
2*5Y	-2.75	0.25	-1.85	4.74	9.15	27.25	-3.00	34.00	-3.00
3*4Y	-0.50	-0.25	-0.30	1.90	3.17	8.50	-0.75	11.25	-0.75
3*5Y	0.00	-0.25	-0.05	3.50	5.74	14.00	-1.00	22.00	-1.00
4*5Y	0.50	0.00	0.25	1.60	2.57	6.00	-0.50	10.75	-0.50
5*7Y	0.75	0.25	0.75	2.53	3.27	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.25	-0.25	5.55	8.55	9.65	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.50	-0.50	4.80	6.03	6.39	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.00	0.00	2.20	2.80	3.18	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	2.25	0.25	2.40	3.39	3.79	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	1.00	0.25	1.25	2.66	3.85	10.25	0.75	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.847	-1.50	1.868	1.879	1.884	1.935	1.400	2.375	1.237
1.5Y	1.877	-1.00	1.898	1.919	1.939	2.113	1.523	2.445	1.232
2Y	1.855	-0.60	1.886	1.924	1.963	2.230	1.625	2.492	1.225
3Y	1.801	-2.90	1.854	1.906	1.969	2.315	1.707	2.585	1.200
4Y	1.880	-1.00	1.914	1.989	2.075	2.502	1.830	2.767	1.232
5Y	1.874	-1.30	1.908	1.995	2.104	2.602	1.874	2.830	1.217
7Y	1.943	-0.40	1.971	2.075	2.200	2.728	1.938	2.996	1.270
10Y	1.977	-2.00	2.017	2.137	2.269	2.815	1.977	3.148	1.355
20Y	1.948	-0.70	1.980	2.093	2.223	2.792	1.940	3.327	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.90	0.00
CALL	1.76	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.21	0.03	109.20	109.23	109.18
LKTB	127.15	0.06	127.22	127.28	127.08

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	1.05	-0.75	2.15	-2.77	-3.29	9.00	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-3.45	-1.75	-1.28	-5.47	-5.14	2.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-3.75	-2.65	-1.63	-5.13	-4.93	-0.30	-18.30	1.80	-25.15
3Y	-1.10	0.15	-0.25	-2.14	-2.14	2.05	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-9.50	-2.00	-6.55	-8.57	-9.59	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-8.40	-1.70	-5.72	-7.49	-9.93	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-14.55	-2.35	-11.23	-12.96	-16.23	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-13.45	-1.25	-11.01	-13.19	-16.78	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-9.55	-2.30	-6.10	-6.08	-8.34	1.75	-36.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-72.75	-1.75
-73.25	-1.25
-70.75	-0.75
-68.00	-0.25
-70.00	0.00
-75.00	-0.50
-70.25	-1.25
-58.25	-0.75

CRS

USD/KRW 1126.50 (+6.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1300	-4.00	1.6200	0.8600	1*2Y	-2.00	0.00
1.5Y	1.1100	-4.00	1.6600	0.9050	2*3Y	0.00	1.00
2Y	1.1100	-4.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-7.00	0.50
3Y	1.1100	-3.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-2.50	0.00
4Y	1.0850	-3.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-7.00	-0.50
5Y	1.0400	-3.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-4.50	-0.50
7Y	1.0950	-4.00	1.8950	1.0950	5*7Y	5.50	-0.50
10Y	1.2600	-4.00	2.0500	1.2600	5*10Y	22.00	-0.50

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	2.7292	0.0081	2.7211	2.7702	2.8272	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.8597	0.0098	2.8499	2.8887	2.9118	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	87.42	1.41	86.01	90.92	91.22	103.03	-53.43	103.03	-206.20
10Y	88.27	2.98	85.29	90.67	87.68	98.82	-24.46	98.82	-75.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	2.50	0.00	2.50	2.00	3.25	42.50	2.00	62.75	2.00
KTB 2*10Y	12.20	-1.40	13.60	12.10	12.00	63.50	12.00	82.90	11.80
UST 2*10Y	13.05	0.17	12.88	11.85	8.46	95.16	8.46	205.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	8y 80.5
06M			
09M	87.25		
01Y	86 / 86.5		
1.5Y			
02Y	82 / 83 / 84	SPRD	10*15y 02
03Y	79 / 79.25 / 79.5 / 81		
04Y	78.5		
05Y	79.75		
07Y			
10Y	85		
12Y			
15Y	87 / 88.25		
20Y			
CRS	2y 11.5 / 3y 11.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	90 건	-66	156	219	194	159	170	204
금 액	19,867 억원	-22,638	42,505	60,201	42,736	51,351	59,470	72,185

장중동향

국고채 금리 하락.

미국채 금리하락에 국채선물 강세 출발. 최근 스왑의 영향을 많이 받으며 리시브 물량이 꾸준함에따라 강세 유지.

IRS는 전 구간 하락.

계속되는 오퍼 물량으로 비드가 나오면 기븐되는 양상을 보이며 레벨 하락.

CRS도 하락 마감.