

IPS Daily Morning Brief

2018-12-13

종가 기준일 2018-12-12

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8975	1.25	1.8890	1.8303	1.7914	1.9050	1.4025	2.3950	1.2875
9M	1.8825	1.00	1.8775	1.8458	1.8265	1.9125	1.4425	2.4000	1.2500
1Y	1.8650	1.00	1.8680	1.8549	1.8517	1.9200	1.4825	2.4050	1.2200
1.5Y	1.8550	1.25	1.8575	1.8648	1.8867	2.0250	1.5400	2.4400	1.1900
2Y	1.8400	1.75	1.8370	1.8685	1.9112	2.1150	1.5875	2.4850	1.1675
3Y	1.8150	2.00	1.8100	1.8751	1.9429	2.2225	1.6600	2.5800	1.1550
4Y	1.8125	2.25	1.8055	1.8910	1.9731	2.2950	1.7100	2.6625	1.1575
5Y	1.8200	2.25	1.8125	1.9055	1.9980	2.3400	1.7550	2.7250	1.1575
7Y	1.8375	3.00	1.8205	1.9293	2.0296	2.3950	1.7975	2.8200	1.1675
10Y	1.8950	3.75	1.8690	1.9886	2.0928	2.4850	1.8425	2.9475	1.2125
12Y	1.9150	3.75	1.8890	2.0156	2.1239	2.5225	1.8625	2.9975	1.2150
15Y	1.9200	3.75	1.8915	2.0218	2.1298	2.5400	1.8650	3.0475	1.2150
20Y	1.9050	3.75	1.8780	2.0130	2.1297	2.5600	1.8525	3.1675	1.2150

6*9M	-1.50	-0.25	-1.15	1.55	3.51	12.50	-1.50	12.50	-6.00
9*12M	-1.75	0.00	-0.95	0.91	2.52	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	-2.50	0.75	-3.10	1.36	5.95	23.00	-4.00	23.00	-5.50
2*3Y	-2.50	0.25	-2.70	0.66	3.17	13.25	-3.25	13.25	-3.25
2*4Y	-2.75	0.50	-3.15	2.25	6.19	21.75	-3.50	23.50	-3.50
2*5Y	-2.00	0.50	-2.45	3.70	8.69	27.25	-3.00	34.00	-3.00
3*4Y	-0.25	0.25	-0.45	1.59	3.02	8.50	-0.75	11.25	-0.75
3*5Y	0.50	0.25	0.25	3.04	5.52	14.00	-1.00	22.00	-1.00
4*5Y	0.75	0.00	0.70	1.45	2.50	6.00	-0.50	10.75	-0.50
5*7Y	1.75	0.75	0.80	2.38	3.15	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	7.50	1.50	5.65	8.31	9.48	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	5.75	0.75	4.85	5.94	6.32	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.70	3.11	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	2.50	0.00	2.25	3.31	3.70	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	1.00	0.00	0.90	2.44	3.69	10.25	0.75	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.837	-0.60	1.852	1.876	1.883	1.935	1.400	2.375	1.237
1.5Y	1.866	-0.60	1.877	1.914	1.938	2.113	1.523	2.445	1.232
2Y	1.844	0.20	1.853	1.915	1.959	2.230	1.625	2.492	1.225
3Y	1.796	0.40	1.811	1.893	1.963	2.315	1.707	2.585	1.200
4Y	1.900	1.80	1.888	1.976	2.067	2.502	1.830	2.767	1.232
5Y	1.905	2.50	1.885	1.979	2.095	2.602	1.874	2.830	1.217
7Y	1.974	2.60	1.950	2.057	2.189	2.728	1.938	2.996	1.270
10Y	2.007	2.50	1.989	2.116	2.257	2.815	1.977	3.148	1.355
20Y	1.980	2.50	1.956	2.075	2.212	2.792	1.940	3.327	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.90	0.00
CALL	1.73	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.17	-0.05	109.20	19.22	109.15
LKTB	126.79	-0.27	127.00	127.02	126.72

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	2.80	1.60	1.62	-2.08	-3.15	9.00	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-1.10	1.85	-1.97	-4.96	-5.09	2.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-0.40	1.55	-1.56	-4.67	-4.82	-0.30	-18.30	1.80	-25.15
3Y	1.90	1.60	-0.12	-1.75	-1.98	2.05	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-8.75	0.45	-8.27	-8.50	-9.44	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-8.50	-0.25	-7.27	-7.38	-9.72	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-13.65	0.40	-12.95	-12.82	-15.97	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-11.20	1.25	-12.00	-12.78	-16.46	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-7.50	1.25	-7.76	-6.22	-8.26	1.75	-36.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1128.50 (-1.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-71.50	1.00	1Y	1.1500	2.00	1.6200	0.8600	1*2Y	-0.50	2.50	
-71.50	2.25	1.5Y	1.1400	3.50	1.6600	0.9050	2*3Y	0.50	-0.50	
-69.50	2.75	2Y	1.1450	4.50	1.6950	0.9200	2*5Y	-5.00	1.00	
-66.50	2.00	3Y	1.1500	4.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-2.00	0.50	
-68.25	2.25	4Y	1.1300	4.50	1.8000	1.0700	3*5Y	-5.50	1.50	
-72.50	3.25	5Y	1.0950	5.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-3.50	1.00	
-66.25	3.00	7Y	1.1750	6.00	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.50	
-54.50	3.25	10Y	1.3500	7.00	2.0500	1.2600	5*10Y	25.50	1.50	

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	2.7785	0.0165	2.7620	2.7292	2.7211	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.9145	0.0360	2.8785	2.8597	2.8499	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	93.45	1.45	92.00	87.42	86.01	103.03	-53.43	103.03	-202.20
10Y	90.75	1.10	89.65	88.27	85.29	98.82	-24.46	98.82	-73.30

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	5.50	2.00	3.50	2.50	2.50	42.50	2.00	62.75	2.00
KTb 2*10Y	16.30	2.30	14.00	12.20	13.60	63.50	12.00	82.90	11.80
UST 2*10Y	13.60	1.95	11.65	13.05	12.88	95.16	8.46	205.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	87.75 / 88								
01Y	86								
1.5Y	84								
02Y	84.25	SPRD	9m*3y -6.25						
03Y	82		5*10y 6.5 / 7.5						
04Y									
05Y	82 / 82.5								
07Y	84								
10Y	89.5								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y 13.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	112 건	29	83	90	156	219	194	159	
금 액	25,005 억원	-136	25,141	19,867	42,505	60,201	42,736	51,351	

장중동향
 금리 상승.
 미국채 금리상승에 약세 출발한 채권은 증시반등과 레벨부담으로 금리 상승 마감. 커브 스티프닝.

IRS도 전구간 레벨 상승.
 비드가 우위를 보이는 가운데 레벨이 오르며 그간 누웠던 커브가 스티프닝.

CRS도 전구간 상승 마감.