

IPS Daily Morning Brief

2018-12-18

종가 기준일 2018-12-17

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8975	0.25	1.8945	1.8479	1.7985	1.9050	1.4050	2.3675	1.2875
9M	1.8825	0.25	1.8800	1.8559	1.8302	1.9125	1.4450	2.3700	1.2500
1Y	1.8625	0.25	1.8615	1.8588	1.8524	1.9200	1.4850	2.3775	1.2200
1.5Y	1.8475	0.25	1.8495	1.8634	1.8841	2.0250	1.5425	2.4075	1.1900
2Y	1.8300	0.25	1.8325	1.8621	1.9058	2.1150	1.5950	2.4450	1.1675
3Y	1.7975	0.00	1.8045	1.8605	1.9332	2.2225	1.6700	2.5350	1.1550
4Y	1.7950	0.00	1.8015	1.8714	1.9609	2.2950	1.7175	2.6075	1.1575
5Y	1.7975	0.00	1.8070	1.8829	1.9844	2.3400	1.7600	2.6700	1.1575
7Y	1.8100	0.25	1.8205	1.9038	2.0145	2.3950	1.7975	2.7775	1.1675
10Y	1.8600	0.00	1.8745	1.9613	2.0768	2.4850	1.8425	2.9050	1.2125
12Y	1.8825	0.25	1.8950	1.9869	2.1070	2.5225	1.8625	2.9575	1.2150
15Y	1.8900	0.25	1.9010	1.9936	2.1126	2.5400	1.8650	3.0100	1.2150
20Y	1.8625	0.00	1.8815	1.9820	2.1110	2.5600	1.8525	3.1300	1.2150

6*9M	-1.50	0.00	-1.45	0.80	3.16	12.50	-1.50	12.50	-6.00
9*12M	-2.00	0.00	-1.85	0.29	2.23	10.50	-2.00	10.50	-4.25
1*2Y	-3.25	0.00	-2.90	0.34	5.34	23.00	-4.00	23.00	-5.50
2*3Y	-3.25	-0.25	-2.80	-0.16	2.73	13.25	-3.25	13.25	-3.25
2*4Y	-3.50	-0.25	-3.10	0.93	5.50	21.75	-3.50	23.50	-3.50
2*5Y	-3.25	-0.25	-2.55	2.08	7.86	27.25	-3.25	34.00	-3.25
3*4Y	-0.25	0.00	-0.30	1.09	2.77	8.50	-0.75	11.25	-0.75
3*5Y	0.00	0.00	0.25	2.24	5.13	14.00	-1.00	22.00	-1.00
4*5Y	0.25	0.00	0.55	1.15	2.35	6.00	-0.50	10.75	-0.50
5*7Y	1.25	0.25	1.35	2.09	3.00	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	6.25	0.00	6.75	7.84	9.24	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	5.00	-0.25	5.40	5.75	6.24	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.25	0.25	2.05	2.56	3.02	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.25	2.65	3.24	3.58	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	0.25	0.00	0.70	2.08	3.41	10.25	0.25	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.827	-1.00	1.837	1.868	1.881	1.935	1.400	2.368	1.237
1.5Y	1.869	-0.50	1.871	1.906	1.934	2.113	1.523	2.420	1.232
2Y	1.847	0.60	1.844	1.900	1.952	2.230	1.627	2.462	1.225
3Y	1.792	1.50	1.790	1.869	1.951	2.315	1.715	2.540	1.200
4Y	1.895	0.30	1.897	1.954	2.053	2.502	1.837	2.705	1.232
5Y	1.885	0.00	1.894	1.955	2.079	2.602	1.874	2.767	1.217
7Y	1.971	0.70	1.969	2.032	2.171	2.728	1.938	2.945	1.270
10Y	2.002	0.20	2.002	2.085	2.237	2.815	1.977	3.097	1.355
20Y	1.971	0.10	1.972	2.046	2.191	2.792	1.940	3.270	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.16	-0.03	109.20	109.21	109.15
LKTb	126.83	-0.03	126.89	127.06	126.80

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	3.55	1.25	2.47	-0.94	-2.86	9.00	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-2.15	0.75	-2.15	-4.25	-4.97	2.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-1.70	-0.35	-1.13	-3.79	-4.64	-0.25	-18.30	1.80	-25.15
3Y	0.55	-1.50	1.47	-0.90	-1.78	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.00	-0.30	-9.53	-8.30	-9.25	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-8.75	0.00	-8.70	-7.22	-9.44	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-16.10	-0.45	-14.85	-12.81	-15.66	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-14.20	-0.20	-12.77	-12.39	-16.01	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-10.85	-0.10	-9.07	-6.39	-8.01	1.75	-36.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1131.30 (+0.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-72.25	2.25	1Y	1.1400	2.50	1.6200	0.8800	1*2Y	-3.00	-3.00		
-74.75	-0.75	1.5Y	1.1000	-0.50	1.6600	0.9050	2*3Y	1.00	0.00		
-72.00	-0.75	2Y	1.1100	-0.50	1.6950	0.9200	2*5Y	-5.00	-0.50		
-67.75	-0.50	3Y	1.1200	-0.50	1.7550	0.9850	3*4Y	-2.50	-0.50		
-70.00	-1.00	4Y	1.0950	-1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-6.00	-0.50		
-73.75	-1.00	5Y	1.0600	-1.00	1.8500	1.0400	4*5Y	-3.50	0.00		
-66.00	-0.75	7Y	1.1500	-0.50	1.8950	1.0950	5*7Y	9.00	0.50		
-53.00	-0.50	10Y	1.3300	-0.50	2.0500	1.2600	5*10Y	27.00	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	2.6958	-0.0455	2.7413	2.7579	2.7785	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.8556	-0.0361	2.8917	2.9135	2.9145	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	84.88	-5.15	90.03	91.29	93.45	103.03	-53.43	103.03	-196.50
10Y	85.36	-3.81	89.17	89.35	90.75	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	3.00	-0.25	3.25	5.75	5.50	42.50	2.00	62.75	2.00
KTb 2*10Y	15.50	-0.40	15.90	17.50	16.30	63.50	12.00	82.90	11.80
UST 2*10Y	15.98	0.94	15.04	15.56	13.60	94.21	8.46	205.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y									
03Y	79.5								
04Y									
05Y	79								
07Y									
10Y	85 / 85.75								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			56 건	-40	96	91	112	83	90
금 액			13,059 억원	-7,164	20,223	40,615	25,005	25,141	19,867

장중동향
국고채 보험권에서 혼조 마감.
FOMC를 앞두고 짙은 관망세. 선물이 강해지니 차익 실현이 나와 다시 하락 마감.

IRS도 전체적으로 전일비 수준.
단기부터 2년 구간은 소폭 레벨이 상승했고, 그 뒤로는 전일비 수준. 오후들어 장기쪽으로 거래가 활발.

CRS는 1년이 오른것을 제외하고 전체테너 레벨 하락 마감.