

IPS Daily Morning Brief

2018-12-28

종가 기준일 2018-12-27

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8950	1.50	1.8930	1.8883	1.8142	1.9050	1.4125	2.3325	1.2875
9M	1.8875	1.50	1.8820	1.8810	1.8377	1.9125	1.4550	2.3350	1.2500
1Y	1.8750	1.25	1.8700	1.8724	1.8536	1.9200	1.5000	2.3425	1.2200
1.5Y	1.8475	0.75	1.8525	1.8633	1.8765	2.0250	1.5550	2.3775	1.1900
2Y	1.8075	0.25	1.8210	1.8459	1.8906	2.1150	1.6000	2.4200	1.1675
3Y	1.7775	0.25	1.7890	1.8240	1.9085	2.2225	1.6750	2.5200	1.1550
4Y	1.7700	0.25	1.7830	1.8233	1.9309	2.2950	1.7250	2.6075	1.1575
5Y	1.7650	0.00	1.7785	1.8259	1.9506	2.3400	1.7400	2.6700	1.1575
7Y	1.7725	0.25	1.7845	1.8381	1.9774	2.3950	1.7475	2.7775	1.1675
10Y	1.8150	0.25	1.8295	1.8896	2.0375	2.4850	1.7950	2.9050	1.2125
12Y	1.8375	0.50	1.8510	1.9124	2.0655	2.5225	1.8175	2.9575	1.2150
15Y	1.8475	0.50	1.8595	1.9185	2.0707	2.5400	1.8250	3.0100	1.2150
20Y	1.8050	0.25	1.8175	1.8956	2.0638	2.5600	1.7875	3.1300	1.2150

6*9M	-0.75	0.00	-1.10	-0.72	2.35	12.50	-1.75	12.50	-6.00
9*12M	-1.25	-0.25	-1.20	-0.86	1.59	10.50	-2.50	10.50	-4.25
1*2Y	-6.75	-1.00	-4.90	-2.65	3.70	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.00	0.00	-3.20	-2.19	1.78	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-3.75	0.00	-3.80	-2.26	4.03	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-4.25	-0.25	-4.25	-2.00	6.00	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.75	0.00	-0.60	-0.07	2.24	8.50	-0.75	11.25	-0.75
3*5Y	-1.25	-0.25	-1.05	0.19	4.21	14.00	-1.25	22.00	-1.25
4*5Y	-0.50	-0.25	-0.45	0.26	1.97	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	0.75	0.25	0.60	1.23	2.68	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.00	0.25	5.10	6.38	8.69	16.25	4.00	30.75	3.75
	4.25	0.00	4.50	5.15	6.01	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.25	0.25	2.15	2.28	2.80	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.25	0.25	3.00	2.89	3.33	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	-1.00	0.00	-1.20	0.60	2.64	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.835	0.00	1.826	1.844	1.873	1.935	1.435	2.360	1.237
1.5Y	1.859	0.20	1.860	1.880	1.923	2.113	1.585	2.405	1.232
2Y	1.852	0.10	1.853	1.867	1.936	2.230	1.675	2.460	1.225
3Y	1.810	0.30	1.821	1.830	1.928	2.315	1.737	2.540	1.200
4Y	1.878	0.30	1.886	1.908	2.021	2.502	1.849	2.705	1.232
5Y	1.876	1.10	1.878	1.901	2.040	2.602	1.825	2.765	1.217
7Y	1.946	0.20	1.956	1.975	2.129	2.728	1.913	2.943	1.270
10Y	1.937	0.00	1.955	2.006	2.187	2.815	1.923	3.096	1.355
20Y	1.953	-0.30	1.956	1.979	2.143	2.792	1.910	3.265	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.92	0.00
CALL	1.82	3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.24	-0.01	109.18	109.27	109.17
LKTb	127.59	0.04	127.21	127.59	127.12

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	4.00	1.25	4.36	2.84	-1.98	9.00	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-1.15	0.55	-0.77	-1.68	-4.69	0.75	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-4.45	0.15	-3.24	-2.09	-4.51	-0.25	-18.30	1.80	-25.15
3Y	-3.25	-0.05	-3.20	-0.57	-1.91	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.80	-0.05	-10.28	-8.43	-9.06	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-11.10	-1.10	-9.97	-7.52	-8.98	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.35	0.05	-17.15	-13.71	-15.20	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-12.20	0.25	-12.51	-11.59	-14.94	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-14.80	0.55	-13.83	-8.37	-7.92	1.75	-34.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1120.00 (-5.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-65.00	2.25	1Y	1.2250	3.50	1.6200	0.8800	1*2Y	-8.00	-2.00		
-68.25	1.25	1.5Y	1.1650	2.00	1.6600	0.9050	2*3Y	-0.50	-0.50		
-66.25	1.25	2Y	1.1450	1.50	1.6950	0.9200	2*5Y	-3.50	-0.50		
-63.75	0.75	3Y	1.1400	1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-1.00	0.00		
-64.00	0.75	4Y	1.1300	1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-3.00	0.00		
-65.50	1.00	5Y	1.1100	1.00	1.8500	1.0400	4*5Y	-2.00	0.00		
-55.25	0.75	7Y	1.2200	1.00	1.8950	1.0950	5*7Y	11.00	0.00		
-40.50	0.75	10Y	1.4100	1.00	2.0500	1.2600	5*10Y	30.00	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	2.5724	-0.0561	2.6285	2.5614	2.6327	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7714	-0.0359	2.8073	2.7413	2.7825	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	72.04	-5.71	77.75	69.44	76.77	103.03	-53.43	103.03	-194.00
10Y	83.44	-3.59	87.03	75.13	80.75	98.82	-24.46	98.82	-69.60

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	0.75	0.00	0.75	2.00	1.00	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	8.50	-0.10	8.60	12.30	11.00	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	19.90	2.02	17.88	17.99	14.98	92.41	8.46	205.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor	11y 83.75			
06M	89.5								
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	81 / 81.5				SPRD	2*3y -3			
03Y	78.25					7*15y 7.5			
04Y	77 / 78.25					10*20y -0.75			
05Y	77.25 / 77.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y 15 / 16								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	57 건		6	51	38	86	105	81	78
금 액	14,805 억원		-9,978	24,783	11,750	27,885	34,432	19,866	18,615

장중동향
국고채 금리 혼조마감. 커브 플랫트닝.
하락해서 시작한 국채선물은 완만히 낙폭을 회복 강보합 마감.

IRS는 대부분 구간 레벨상승.
북클로징과 연말 장세로 거래가 적은가운데 제한적으로 거래.

CRS도 단기를 중심으로 레벨 상승 마감.