IPS Daily Morning Brief

2018-11-09

종가 기준일 2018-11-08

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7725	0.25	1.7760	1.7803	1.7551	1.8075	1.4025	2.5600	1.2875
9M	1.8075	0.25	1.8090	1.8156	1.8000	1.8500	1.4425	2.5250	1.2500
1Y	1.8300	0.00	1.8350	1.8456	1.8303	1.9100	1.4825	2.5000	1.2200
1.5Y	1.8600	-0.25	1.8700	1.8853	1.8763	2.0250	1.5350	2.5000	1.1900
2Y	1.8875	-0.25	1.9025	1.9185	1.9087	2.1150	1.5650	2.5075	1.1675
3Y	1.9250	-0.75	1.9460	1.9585	1.9520	2.2225	1.6200	2.5800	1.1550
4Y	1.9575	-0.50	1.9770	1.9926	1.9898	2.2950	1.6600	2.6625	1.1575
5Y	1.9850	-0.75	2.0055	2.0233	2.0211	2.3400	1.6900	2.7250	1.1575
7Y	2.0175	-0.75	2.0380	2.0584	2.0599	2.3950	1.7300	2.8325	1.1675
10Y	2.0800	-0.75	2.1015	2.1221	2.1251	2.4850	1.8025	2.9750	1.2125
12Y	2.1100	-0.75	2.1305	2.1514	2.1606	2.5225	1.8325	3.0275	1.2150
15Y	2.1125	-0.75	2.1330	2.1539	2.1696	2.5400	1.8325	3.0725	1.2150
20Y	2.1200	-0.75	2.1395	2.1583	2.1756	2.5600	1.8325	3.1925	1.2150
6*9M	3.50	0.00	3.30	3.54	4.48	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	2.25	-0.25	2.60	3.00	3.04	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	5.75	-0.25	6.75	7.29	7.83	23.00	4.25	23.00	-5.50
2*3Y	3.75	-0.50	4.35	4.00	4.34	13.25	3.25	13.25	-1.75
2*4Y	7.00	-0.25	7.45	7.41	8.12	21.75	6.25	23.50	-1.75
2*5Y	9.75	-0.50	10.30	10.48	11.25	27.25	9.00	34.00	-1.75
3*4Y	3.25	0.25	3.10	3.41	3.78	8.50	3.00	11.25	-0.50
3*5Y	6.00	0.00	5.95	6.48	6.91	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	2.75	-0.25	2.85	3.06	3.13	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.25	0.00	3.25	3.51	3.88	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.50	0.00	9.60	9.89	10.40	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.00	6.35	6.38	6.52	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	2.90	2.93	3.55	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.25	0.00	3.15	3.18	4.45	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	0.00	3.80	3.61	5.05	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.874	0.40	1.879	1.888	1.852	1.935	1.400	2.451	1.237
1.5Y	1.917	0.30	1.922	1.940	1.916	2.113	1.523	2.460	1.232
2Y	1.947	0.10	1.957	1.971	1.954	2.230	1.625	2.492	1.225
3Y	1.962	0.20	1.972	1.981	1.981	2.315	1.677	2.585	1.200
4Y	2.055	0.30	2.068	2.080	2.094	2.502	1.789	2.767	1.232
5Y	2.082	0.20	2.099	2.120	2.152	2.602	1.850	2.830	1.217
7Y	2.176	0.00	2.196	2.219	2.263	2.728	2.025	2.996	1.270
10Y	2.250	0.00	2.269	2.290	2.337	2.815	2.115	3.148	1.355
20Y	2.185	-1.00	2.213	2.231	2.290	2.792	2.128	3.327	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.47	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.66	-0.01	108.62	108.68	108.60
LKTB	124.43	0.02	124.14	124.43	124.08

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	-4.40	-0.40	-4.40	-4.20	-2.17	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-5.70	-0.55	-5.20	-5.47	-4.00	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-5.95	-0.35	-5.45	-5.24	-4.49	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-3.70	-0.95	-2.60	-2.27	-2.86	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-9.75	-0.80	-9.12	-8.74	-10.41	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.70	-0.95	-9.35	-9.64	-13.08	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-15.85	-0.75	-15.80	-16.05	-20.27	-13.95	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-17.00	-0.75	-16.73	-16.80	-21.17	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-6.50	0.25	-7.37	-7.26	-11.41	-5.50	-38.75	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-49.50	-4.50
-55.00	-3.75
-60.75	-3.75
-65.50	-3.75
-67.75	-4.00
-66.00	-3.75
-62.75	-3.75
-50.00	-3.75

CRS

USD/KRW 1117.30 (-6.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3350	-4.50	1.6200	0.8250	1*2Y	-5.50	0.50
1.5Y	1.3100	-4.00	1.6600	0.8800	2*3Y	-1.00	-0.50
2Y	1.2800	-4.00	1.6950	0.9200	2*5Y	4.50	-0.50
3Y	1.2700	-4.50	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	0.00
4Y	1.2800	-4.50	1.8000	1.0700	3*5Y	5.50	0.00
5Y	1.3250	-4.50	1.8500	1.1200	4*5Y	4.50	0.00
7Y	1.3900	-4.50	1.8950	1.1500	5*7Y	6.50	0.00
10Y	1.5800	-4.50	2.0500	1.2450	5*10Y	25.50	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	2.9773	0.0206	2.9567	2.9320	2.9116	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	3.2382	0.0010	3.2372	3.2309	3.2013	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	103.03	1.96	101.07	96.50	95.16	103.03	-53.43	103.03	-207.00
10Y	98.82	0.10	98.72	93.89	92.93	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	19.25	-0.50	19.75	20.50	19.75	42.50	19.00	62.75	2.75
KTB 2*10Y	30.30	-0.10	30.40	32.50	31.20	63.50	26.60	82.90	11.80
UST 2*10Y	26.09	-1.96	28.05	29.89	28.97	98.63	18.51	205.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	78	ODD Tenor	
09M			
01Y	84		
1.5Y	86.25 / 87.75		
02Y	89 / 89.75	SPRD	6*12m 06
03Y	92.75 / 93.25 / 94 / 94.25		1*2y 6.5
04Y			2*3y 4.25 / 4.5
05Y	01 / 1.25 / 1.5		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	117 건	1	116	81	59	99	98	112
금 액	44,072 억원	-12	44,084	24,795	12,060	41,670	37,715	32,865

장중동향

채권 혼조 마감.

미국 중간선거 불확실성이 해소되며 증시가 급등했고, 그영향으로 국내채권은 약세로 시작. 저가매수와 국내경제의 하방압력 지속으로 낙폭 만회.

IRS는 채권과 연동하는 분위기였고 보합권에서 단기 소폭상승, 장기 소폭하락 마감. 커브 플래트닝.

CRS는 전체 하락마감.