IPS Daily Morning Brief

2018-11-15

종가 기준일 2018-11-14

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7700	-0.25	1.7720	1.7763	1.7585	1.8075	1.4025	2.5600	1.2875
9M	1.8050	-0.25	1.8070	1.8078	1.8027	1.8500	1.4425	2.5125	1.2500
1Y	1.8225	-0.25	1.8260	1.8329	1.8328	1.9100	1.4825	2.4825	1.2200
1.5Y	1.8450	-0.50	1.8520	1.8670	1.8774	2.0250	1.5400	2.4825	1.1900
2Y	1.8675	-0.50	1.8760	1.8974	1.9090	2.1150	1.5725	2.4975	1.1675
3Y	1.8975	-0.75	1.9100	1.9351	1.9519	2.2225	1.6250	2.5800	1.1550
4Y	1.9250	-0.75	1.9395	1.9669	1.9891	2.2950	1.6625	2.6625	1.1575
5Y	1.9475	-0.75	1.9640	1.9956	2.0196	2.3400	1.6900	2.7250	1.1575
7Y	1.9775	-0.50	1.9945	2.0301	2.0576	2.3950	1.7300	2.8325	1.1675
10Y	2.0400	-0.50	2.0570	2.0940	2.1225	2.4850	1.8025	2.9750	1.2125
12Y	2.0700	-0.50	2.0870	2.1226	2.1575	2.5225	1.8325	3.0275	1.2150
15Y	2.0725	-0.50	2.0895	2.1246	2.1656	2.5400	1.8325	3.0725	1.2150
20Y	2.0725	-0.50	2.0935	2.1296	2.1715	2.5600	1.8325	3.1925	1.2150

6*9M	3.50	0.00	3.50	3.15	4.42	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	1.75	0.00	1.90	2.51	3.00	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	4.50	-0.25	5.00	6.45	7.63	23.00	4.25	23.00	-5.50
2*3Y	3.00	-0.25	3.40	3.78	4.28	13.25	3.00	13.25	-1.75
2*4Y	5.75	-0.25	6.35	6.95	8.00	21.75	5.75	23.50	-1.75
2*5Y	8.00	-0.25	8.80	9.83	11.05	27.25	8.00	34.00	-1.75
3*4Y	2.75	0.00	2.95	3.18	3.72	8.50	2.75	11.25	-0.50
3*5Y	5.00	0.00	5.40	6.05	6.77	14.00	5.00	22.00	-0.50
4*5Y	2.25	0.00	2.45	2.88	3.05	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.00	0.25	3.05	3.45	3.80	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.25	0.25	9.30	9.84	10.29	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.00	6.25	6.39	6.49	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	2.86	3.50	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.25	0.00	3.25	3.06	4.31	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.25	0.00	3.65	3.56	4.90	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	0.30	1.874	1.882	1.857	1.935	1.400	2.405	1.237
1.5Y	1.915	-0.80	1.921	1.927	1.919	2.113	1.523	2.445	1.232
2Y	1.925	-0.70	1.939	1.956	1.954	2.230	1.625	2.492	1.225
3Y	1.922	-1.30	1.943	1.961	1.979	2.315	1.677	2.585	1.200
4Y	2.022	-0.80	2.035	2.055	2.092	2.502	1.790	2.767	1.232
5Y	2.042	-0.80	2.056	2.088	2.144	2.602	1.850	2.830	1.217
7Y	2.128	-1.00	2.147	2.186	2.252	2.728	2.025	2.996	1.270
10Y	2.197	-1.00	2.218	2.258	2.324	2.815	2.115	3.148	1.355
20Y	2.140	-0.50	2.156	2.202	2.275	2.792	2.128	3.327	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.49	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.80	0.03	108.77	108.83	108.76
LKTB	124.99	0.05	124.92	125.09	124.92

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	-5.15	-0.55	-4.76	-4.90	-2.39	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.00	0.30	-6.86	-6.01	-4.17	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-5.75	0.20	-6.28	-5.83	-4.45	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-2.45	0.55	-3.34	-2.62	-2.69	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-9.70	0.05	-9.59	-8.85	-10.29	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.45	0.05	-9.18	-9.22	-12.40	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-15.05	0.50	-15.21	-15.57	-19.42	-13.95	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-15.70	0.50	-16.08	-16.38	-20.14	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-6.75	0.00	-6.25	-7.23	-10.32	-5.20	-38.25	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-51.25	-3.25
-57.00	0.50
-63.75	0.50
-66.25	0.75
-68.00	0.75
-66.25	0.75
-62.75	0.50
-50.00	0.50

CRS

USD/KRW 1134.30 (+1.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3100	-3.50	1.6200	0.8400	1*2Y	-8.00	3.50
1.5Y	1.2750	0.00	1.6600	0.8850	2*3Y	0.50	0.00
2Y	1.2300	0.00	1.6950	0.9200	2*5Y	5.50	0.00
3Y	1.2350	0.00	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	0.00
4Y	1.2450	0.00	1.8000	1.0700	3*5Y	5.00	0.00
5Y	1.2850	0.00	1.8500	1.1350	4*5Y	4.00	0.00
7Y	1.3500	0.00	1.8950	1.1700	5*7Y	6.50	0.00
10Y	1.5400	0.00	2.0500	1.2650	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	2.8705	-0.0247	2.8952	2.9282	2.9282	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	3.1250	-0.0174	3.1424	3.1838	3.1838	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	94.55	-1.77	96.32	98.32	98.32	103.03	-53.43	103.03	-207.00
10Y	92.80	-0.74	93.54	97.38	95.88	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	17.25	0.00	17.25	18.00	18.75	42.50	17.25	62.75	2.75
KTB 2*10Y	27.20	-0.30	27.50	26.50	28.00	63.50	26.50	82.90	11.80
UST 2*10Y	25.45	0.73	24.72	25.56	25.56	98.63	18.51	205.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	77.25 / 77.5	ODD Tenor	
09M	80.75		
01Y	82.25 / 82.75		
1.5Y	84.5		
02Y	86.5	SPRD	6*9m 3.5
03Y			9*12m 1.75
04Y			1*2y 4.25
05Y	94.75		2*3y 03
07Y			2*5y 8.25
10Y	4		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3y 23		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	82 건	-7	89	50	72	117	116	81
금 액	49,355 억원	26,407	22,948	12,445	23,675	44,072	44,084	24,795

장중동향

채권 강보합 금리하락.
특별히 영향력있는 재료없이 주식의 움직임에 연동하며 눈치보기 장세.

IRS는 국채선물의 움직임따라 강보합.
아웃라잇보다 스프레드 호가와 거래가 우세.

CRS는 보합권 유지.