IPS Daily Morning Brief

2018-11-22

종가 기준일 2018-11-21

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7775	0.00	1.7785	1.7714	1.7631	1.8075	1.4025	2.5450	1.2875
9M	1.8125	0.00	1.8135	1.8025	1.8059	1.8500	1.4425	2.5025	1.2500
1Y	1.8350	0.00	1.8360	1.8239	1.8355	1.9100	1.4825	2.4725	1.2200
1.5Y	1.8575	0.25	1.8580	1.8530	1.8783	2.0250	1.5400	2.4825	1.1900
2Y	1.8750	0.75	1.8740	1.8783	1.9088	2.1150	1.5875	2.4975	1.1675
3Y	1.9025	1.00	1.9000	1.9129	1.9505	2.2225	1.6600	2.5800	1.1550
4Y	1.9325	1.25	1.9300	1.9435	1.9872	2.2950	1.7100	2.6625	1.1575
5Y	1.9550	1.25	1.9535	1.9700	2.0168	2.3400	1.7550	2.7250	1.1575
7Y	1.9875	1.25	1.9860	2.0034	2.0539	2.3950	1.8075	2.8325	1.1675
10Y	2.0525	1.00	2.0525	2.0675	2.1192	2.4850	1.8850	2.9750	1.2125
12Y	2.0825	1.00	2.0825	2.0965	2.1535	2.5225	1.9175	3.0275	1.2150
15Y	2.0875	1.00	2.0860	2.0990	2.1607	2.5400	1.9225	3.0725	1.2150
20Y	2.0825	1.00	2.0820	2.1021	2.1654	2.5600	1.9325	3.1925	1.2150

6*9M	3.50	0.00	3.50	3.11	4.28	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	2.25	0.00	2.25	2.14	2.96	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	4.00	0.75	3.80	5.44	7.33	23.00	3.25	23.00	-5.50
2*3Y	2.75	0.25	2.60	3.46	4.18	13.25	2.00	13.25	-1.75
2*4Y	5.75	0.50	5.60	6.53	7.84	21.75	5.00	23.50	-1.75
2*5Y	8.00	0.50	7.95	9.18	10.80	27.25	7.25	34.00	-1.75
3*4Y	3.00	0.25	3.00	3.06	3.67	8.50	2.75	11.25	-0.50
3*5Y	5.25	0.25	5.35	5.71	6.63	14.00	5.00	22.00	-0.50
4*5Y	2.25	0.00	2.35	2.65	2.96	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.25	0.00	3.25	3.34	3.71	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.75	-0.25	9.90	9.75	10.24	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	-0.25	6.65	6.41	6.53	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	2.90	3.44	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.35	3.15	4.15	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.00	0.00	2.95	3.46	4.62	10.25	2.75	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.896	0.00	1.889	1.883	1.865	1.935	1.400	2.385	1.237
1.5Y	1.938	0.00	1.932	1.926	1.925	2.113	1.523	2.445	1.232
2Y	1.950	0.30	1.946	1.947	1.957	2.230	1.625	2.492	1.225
3Y	1.947	0.70	1.942	1.949	1.977	2.315	1.707	2.585	1.200
4Y	2.037	0.20	2.041	2.041	2.090	2.502	1.830	2.767	1.232
5Y	2.050	0.30	2.053	2.066	2.134	2.602	1.905	2.830	1.217
7Y	2.140	0.40	2.142	2.161	2.239	2.728	2.083	2.996	1.270
10Y	2.210	0.50	2.212	2.232	2.311	2.815	2.160	3.148	1.355
20Y	2.167	0.20	2.169	2.181	2.261	2.792	2.128	3.327	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.51	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.74	-0.02	108.78	108.79	108.74
LKTB	124.88	-0.09	125.01	125.10	124.86

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	-6.10	0.00	-5.34	-5.95	-2.90	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-8.05	0.25	-7.42	-7.25	-4.70	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-7.50	0.45	-7.24	-6.88	-4.79	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.45	0.30	-4.24	-3.61	-2.67	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-10.45	1.05	-11.12	-9.80	-10.31	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.50	0.95	-9.99	-9.60	-11.69	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-15.25	0.85	-15.62	-15.74	-18.53	-13.95	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-15.75	0.50	-15.99	-16.49	-19.15	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-8.45	0.80	-8.68	-7.84	-9.56	-5.20	-38.25	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-65.00	-0.50
-68.25	-0.75
-71.50	-0.75
-71.75	-0.50
-76.25	-2.25
-77.00	-4.25
-74.25	-4.75
-61.75	-4.50

CRS

USD/KRW 1131.60 (+5.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1850	-0.50	1.6200	0.8600	1*2Y	-2.50	0.50
1.5Y	1.1750	-0.50	1.6600	0.9050	2*3Y	2.50	0.50
2Y	1.1600	0.00	1.6950	0.9200	2*5Y	2.50	-3.00
3Y	1.1850	0.50	1.7550	0.9850	3*4Y	-1.50	-1.50
4Y	1.1700	-1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	0.00	-3.50
5Y	1.1850	-3.00	1.8500	1.1350	4*5Y	1.50	-2.00
7Y	1.2450	-3.50	1.8950	1.2150	5*7Y	6.00	-0.50
10Y	1.4350	-3.50	2.0500	1.3400	5*10Y	25.00	-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	2.8118	0.0039	2.8079	2.7872	2.8039	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	3.0637	0.0000	3.0637	3.0692	3.0647	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	86.18	0.09	86.09	84.22	85.39	103.03	-53.43	103.03	-207.00
10Y	85.37	-0.50	85.87	87.22	84.47	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	17.75	0.25	17.50	17.00	18.00	42.50	17.00	62.75	2.75
KTB 2*10Y	26.00	0.20	25.80	25.20	27.00	63.50	25.20	82.90	11.80
UST 2*10Y	25.19	-0.39	25.58	28.20	26.08	98.63	18.51	205.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	87.5 / 87 / 87.25	SPRD	9*12M 2.25
03Y	90		
04Y	93 / 93.5		
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2*3yCCS 03		

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	96 건	26	70	52	109	92	82	89
금 액	25,459 억원	-2,356	27,815	13,700	28,378	35,130	49,355	22,948

장중동향

국고채 금리, 재료 부재에 금통위 대기모드로 금리 소폭 상승. 20년 이상 초장기물 금리 소폭 하락.
장 초반 강세 압력이 다소 크긴 했지만 변동폭은 작았고, 장중 줄곧 보합권에서 등락. 금통위를 앞두고 박스권 장세.

IRS, 1.5Y 이상 구간에서 금리 상승.

CRS, 2-3Y을 제외한 구간에서 금리 하락.
중장기 구간에서 에셋 물량이 나온 영향.