

IPS Daily Morning Brief

2018-11-02

종가 기준일 2018-11-01

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7575	0.00	1.7575	1.7784	1.7520	1.8075	1.4000	2.5800	1.2875
9M	1.7825	0.00	1.7795	1.8216	1.7979	1.8500	1.4325	2.5625	1.2500
1Y	1.8000	0.00	1.7960	1.8600	1.8286	1.9100	1.4650	2.5450	1.2200
1.5Y	1.8375	0.25	1.8280	1.9058	1.8767	2.0250	1.5100	2.5475	1.1900
2Y	1.8725	0.25	1.8560	1.9426	1.9093	2.1150	1.5400	2.5500	1.1675
3Y	1.9100	0.50	1.8910	1.9855	1.9538	2.2225	1.5950	2.6000	1.1550
4Y	1.9450	0.50	1.9235	2.0234	1.9930	2.2950	1.6300	2.6675	1.1575
5Y	1.9750	0.50	1.9520	2.0554	2.0248	2.3400	1.6625	2.7300	1.1575
7Y	2.0125	0.50	1.9890	2.0914	2.0645	2.3950	1.7050	2.8325	1.1675
10Y	2.0750	0.25	2.0525	2.1561	2.1293	2.4850	1.7825	2.9750	1.2125
12Y	2.1025	0.25	2.0800	2.1874	2.1655	2.5225	1.8175	3.0275	1.2150
15Y	2.1050	0.25	2.0820	2.1914	2.1755	2.5400	1.8250	3.0725	1.2150
20Y	2.1100	0.25	2.0880	2.1941	2.1813	2.5600	1.8250	3.1925	1.2150

6*9M	2.50	0.00	2.20	4.33	4.59	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	1.75	0.00	1.65	3.44	3.07	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	7.25	0.25	6.00	8.66	8.07	23.00	4.25	23.00	-5.50
2*3Y	3.75	0.25	3.50	4.29	4.45	13.25	3.25	13.25	-1.75
2*4Y	7.25	0.25	6.75	8.08	8.37	21.75	6.25	23.50	-1.75
2*5Y	10.25	0.25	9.60	11.28	11.55	27.25	9.00	34.00	-1.75
3*4Y	3.50	0.00	3.25	3.79	3.91	8.50	3.00	11.25	-0.50
3*5Y	6.50	0.00	6.10	6.99	7.09	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.00	0.00	2.85	3.20	3.18	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.75	0.00	3.70	3.60	3.97	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	-0.25	10.05	10.08	10.45	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	-0.25	6.35	6.48	6.48	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	3.13	3.62	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.00	2.95	3.53	4.63	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	0.00	3.55	3.80	5.20	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.877	-1.00	1.884	1.892	1.849	1.935	1.400	2.525	1.237
1.5Y	1.916	-0.40	1.919	1.960	1.918	2.113	1.523	2.540	1.232
2Y	1.932	-0.70	1.938	1.991	1.957	2.230	1.612	2.552	1.225
3Y	1.940	-0.20	1.933	2.004	1.987	2.315	1.677	2.595	1.200
4Y	2.040	0.40	2.018	2.113	2.101	2.502	1.782	2.767	1.232
5Y	2.080	0.50	2.052	2.157	2.166	2.602	1.847	2.830	1.217
7Y	2.179	0.50	2.154	2.258	2.279	2.728	2.024	2.996	1.270
10Y	2.252	0.70	2.226	2.328	2.355	2.815	2.115	3.148	1.355
20Y	2.196	0.40	2.178	2.272	2.310	2.792	2.128	3.327	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.51	-5.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.74	0.02	108.73	108.75	108.61
LKTb	124.41	-0.05	124.50	124.50	124.12

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	-7.70	1.00	-8.76	-3.65	-2.02	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.85	0.65	-9.14	-5.38	-4.10	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-5.95	0.95	-8.20	-4.79	-4.79	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-3.00	0.70	-4.22	-1.87	-3.33	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-9.50	0.10	-9.41	-8.95	-10.80	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.50	0.00	-9.98	-10.21	-14.17	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-16.65	0.00	-16.46	-16.64	-21.46	-13.95	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-17.70	-0.45	-17.37	-17.21	-22.60	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-8.60	-0.15	-9.00	-7.75	-12.84	-5.50	-39.75	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS				USD/KRW		1138.10 (-1.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-46.00	-0.50	1Y	1.3400	-0.50	1.6200	0.8250	1*2Y	-8.50	-0.50
-55.25	-0.75	1.5Y	1.2850	-0.50	1.6600	0.8800	2*3Y	-0.50	0.50
-61.75	-1.25	2Y	1.2550	-1.00	1.6950	0.9450	2*5Y	6.00	1.00
-66.00	-1.00	3Y	1.2500	-0.50	1.7550	0.9850	3*4Y	0.50	0.00
-69.00	-1.00	4Y	1.2550	-0.50	1.8000	1.0700	3*5Y	6.50	0.50
-66.00	-0.50	5Y	1.3150	0.00	1.8500	1.1200	4*5Y	6.00	0.50
-63.25	-0.50	7Y	1.3800	0.00	1.8950	1.1500	5*7Y	6.50	0.00
-50.50	-0.25	10Y	1.5700	0.00	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	2.8425	-0.0163	2.8588	2.8588	2.8225	2.9124	1.2620	2.9124	0.3100
10Y	3.1327	0.0105	3.1222	3.1222	3.0873	3.2306	2.0387	3.2306	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	91.05	-0.93	91.98	91.88	92.85	94.22	-53.43	94.22	-210.20
10Y	88.07	0.35	87.72	90.02	92.73	92.73	-24.46	92.73	-76.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	20.25	0.00	20.25	19.50	19.00	42.50	19.00	62.75	2.75
KTb 2*10Y	32.00	1.40	30.60	28.20	26.60	63.50	26.60	82.90	11.80
UST 2*10Y	29.02	2.68	26.34	26.34	26.48	98.63	18.51	209.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
	06M	77							
	09M	79.25							
	01Y	82.25							
	1.5Y	86.25							
	02Y	90			SPRD				
	03Y	93.75 / 93.5							
	04Y								
	05Y	97.75							
	07Y								
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	98 건	-14	112	169	134	165	149	127	
금 액	37,715 억원	4,850	32,865	61,663	40,263	62,515	53,245	37,035	

장종동향
국고채 금리, 주식시장에 연동되며 금리 소폭 상승.
IRS, 전반적 금리 상승세.
채권금리에 연동되며 전반적으로 비디쉬.

CRS, 금리 전반 하락.
전일 5bp 가량 상승해 쉬어가는 분위기.