

IPS Daily Morning Brief

2018-11-05

종가 기준일 2018-11-02

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7800	2.25	1.7570	1.7788	1.7527	1.8075	1.4000	2.5725	1.2875
9M	1.8100	2.75	1.7795	1.8201	1.7983	1.8500	1.4325	2.5500	1.2500
1Y	1.8375	3.75	1.7980	1.8536	1.8290	1.9100	1.4650	2.5325	1.2200
1.5Y	1.8750	3.75	1.8305	1.9014	1.8767	2.0250	1.5100	2.5350	1.1900
2Y	1.9100	3.75	1.8600	1.9378	1.9093	2.1150	1.5400	2.5425	1.1675
3Y	1.9550	4.50	1.8970	1.9800	1.9536	2.2225	1.5950	2.5900	1.1550
4Y	1.9875	4.25	1.9300	2.0173	1.9925	2.2950	1.6300	2.6625	1.1575
5Y	2.0150	4.00	1.9585	2.0490	2.0242	2.3400	1.6625	2.7250	1.1575
7Y	2.0475	3.50	1.9945	2.0848	2.0637	2.3950	1.7050	2.8325	1.1675
10Y	2.1125	3.75	2.0585	2.1494	2.1286	2.4850	1.7825	2.9750	1.2125
12Y	2.1400	3.75	2.0860	2.1801	2.1646	2.5225	1.8175	3.0275	1.2150
15Y	2.1425	3.75	2.0885	2.1838	2.1745	2.5400	1.8250	3.0725	1.2150
20Y	2.1475	3.75	2.0940	2.1868	2.1802	2.5600	1.8250	3.1925	1.2150

6*9M	3.00	0.50	2.25	4.14	4.57	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	2.75	1.00	1.85	3.35	3.06	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	7.25	0.00	6.20	8.41	8.03	23.00	4.25	23.00	-5.50
2*3Y	4.50	0.75	3.70	4.23	4.43	13.25	3.25	13.25	-1.75
2*4Y	7.75	0.50	7.00	7.95	8.32	21.75	6.25	23.50	-1.75
2*5Y	10.50	0.25	9.85	11.13	11.49	27.25	9.00	34.00	-1.75
3*4Y	3.25	-0.25	3.30	3.73	3.89	8.50	3.00	11.25	-0.50
3*5Y	6.00	-0.50	6.15	6.90	7.05	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	2.75	-0.25	2.85	3.18	3.17	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.25	-0.50	3.60	3.58	3.95	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.75	-0.25	10.00	10.04	10.44	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.25	6.40	6.46	6.49	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	3.08	3.60	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.00	3.00	3.44	4.59	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	0.00	3.55	3.74	5.16	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.892	1.50	1.879	1.892	1.850	1.935	1.400	2.518	1.237
1.5Y	1.929	1.30	1.914	1.955	1.918	2.113	1.523	2.535	1.232
2Y	1.965	3.30	1.934	1.986	1.957	2.230	1.612	2.552	1.225
3Y	1.980	4.00	1.935	1.999	1.986	2.315	1.677	2.595	1.200
4Y	2.080	4.00	2.023	2.106	2.100	2.502	1.782	2.767	1.232
5Y	2.115	3.50	2.059	2.150	2.164	2.602	1.847	2.830	1.217
7Y	2.211	3.20	2.160	2.250	2.276	2.728	2.024	2.996	1.270
10Y	2.280	2.80	2.232	2.320	2.352	2.815	2.115	3.148	1.355
20Y	2.227	3.10	2.183	2.262	2.306	2.792	2.128	3.327	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.46	-5.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.60	-0.14	108.69	108.72	108.55
LKTb	124.13	-0.28	124.23	124.42	123.77

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	-5.45	2.25	-8.12	-3.81	-2.08	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-5.40	2.45	-8.37	-5.40	-4.10	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-5.50	0.45	-7.40	-4.85	-4.75	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-2.50	0.50	-3.82	-1.92	-3.25	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-9.25	0.25	-9.32	-8.88	-10.74	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.00	0.50	-10.03	-10.10	-13.98	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-16.35	0.30	-16.51	-16.51	-21.24	-13.95	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.75	0.95	-17.33	-17.06	-22.31	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-7.95	0.65	-8.90	-7.52	-12.55	-5.50	-39.25	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1121.60 (-16.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-46.25	-0.25	1Y	1.3750	3.50	1.6200	0.8250	1*2Y	-8.00	0.50		
-56.00	-0.75	1.5Y	1.3150	3.00	1.6600	0.8800	2*3Y	-0.50	0.00		
-61.50	0.25	2Y	1.2950	4.00	1.6950	0.9300	2*5Y	6.50	0.50		
-66.50	-0.50	3Y	1.2900	4.00	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	0.50		
-68.75	0.25	4Y	1.3000	4.50	1.8000	1.0700	3*5Y	7.00	0.50		
-65.50	0.50	5Y	1.3600	4.50	1.8500	1.1200	4*5Y	6.00	0.00		
-62.25	1.00	7Y	1.4250	4.50	1.8950	1.1500	5*7Y	6.50	0.00		
-49.75	0.75	10Y	1.6150	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	2.9197	0.0772	2.8425	2.8588	2.8588	2.9197	1.2620	2.9197	0.3100
10Y	3.2136	0.0809	3.1327	3.1222	3.1222	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	95.47	4.42	91.05	91.98	91.88	95.47	-53.43	95.47	-210.20
10Y	93.36	5.29	88.07	87.72	90.02	93.36	-24.46	93.36	-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	20.25	19.50	42.50	19.00	62.75	2.75
KTb 2*10Y	31.50	-0.50	32.00	30.60	28.20	63.50	26.60	82.90	11.80
UST 2*10Y	29.39	0.37	29.02	26.34	26.34	98.63	18.51	209.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor	6y 3.75			
06M	76.5 / 78.25								
09M	79 / 79.5								
01Y	81 / 81.25 / 83.5 / 83.75								
1.5Y	87.5								
02Y	88 / 89.5 / 91 / 91.25								
03Y	94 / 95 / 95.5 / 96				SPRD	6*12m 5.5			
04Y						9*12m 1.75			
05Y	99 / 1.5 / 02					2*5y 10.5			
07Y	05 / 5.5					2*10y 20.25			
10Y	8.5 / 09 / 11 / 11.5					4*8y 08			
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y 37.5 / 1.5y 31.5 / 2y 31.5								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	99 건		1	98	112	169	134	165	149
금 액	41,670 억원		3,955	37,715	32,865	61,663	40,263	62,515	53,245

장종동향

국고채 금리, 미중 무역 분쟁 합의 가능성에 금리 급등.

IRS, 트럼프 발언 영향으로 금리 상승.

도널드 트럼프 대통령이 미중 무역합의 발언을 한 영향

CRS, 전 구간 금리 상승.