

IPS Daily Morning Brief

2018-11-06

종가 기준일 2018-11-05

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7775	-0.25	1.7660	1.7790	1.7533	1.8075	1.4025	2.5700	1.2875
9M	1.8075	-0.25	1.7920	1.8185	1.7988	1.8500	1.4400	2.5475	1.2500
1Y	1.8350	-0.25	1.8135	1.8511	1.8293	1.9100	1.4800	2.5300	1.2200
1.5Y	1.8725	-0.25	1.8490	1.8969	1.8766	2.0250	1.5225	2.5350	1.1900
2Y	1.9075	-0.25	1.8815	1.9328	1.9092	2.1150	1.5525	2.5425	1.1675
3Y	1.9525	-0.25	1.9210	1.9744	1.9533	2.2225	1.6100	2.5900	1.1550
4Y	1.9825	-0.50	1.9540	2.0109	1.9919	2.2950	1.6500	2.6625	1.1575
5Y	2.0100	-0.50	1.9825	2.0424	2.0235	2.3400	1.6850	2.7250	1.1575
7Y	2.0425	-0.50	2.0175	2.0779	2.0628	2.3950	1.7300	2.8325	1.1675
10Y	2.1050	-0.75	2.0815	2.1423	2.1278	2.4850	1.8025	2.9750	1.2125
12Y	2.1325	-0.75	2.1090	2.1725	2.1636	2.5225	1.8325	3.0275	1.2150
15Y	2.1350	-0.75	2.1115	2.1758	2.1733	2.5400	1.8325	3.0725	1.2150
20Y	2.1400	-0.75	2.1165	2.1790	2.1790	2.5600	1.8325	3.1925	1.2150

6*9M	3.00	0.00	2.60	3.95	4.54	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	2.75	0.00	2.15	3.26	3.05	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	7.25	0.00	6.80	8.16	7.99	23.00	4.25	23.00	-5.50
2*3Y	4.50	0.00	3.95	4.16	4.41	13.25	3.25	13.25	-1.75
2*4Y	7.50	-0.25	7.25	7.81	8.27	21.75	6.25	23.50	-1.75
2*5Y	10.25	-0.25	10.10	10.96	11.43	27.25	9.00	34.00	-1.75
3*4Y	3.00	-0.25	3.30	3.65	3.86	8.50	3.00	11.25	-0.50
3*5Y	5.75	-0.25	6.15	6.80	7.01	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	2.75	0.00	2.85	3.15	3.15	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.25	0.00	3.50	3.55	3.93	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.50	-0.25	9.90	9.99	10.43	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	-0.25	6.40	6.44	6.50	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	3.03	3.59	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.00	3.00	3.35	4.55	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	0.00	3.50	3.68	5.13	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.882	-1.00	1.885	1.890	1.850	1.935	1.400	2.518	1.237
1.5Y	1.925	-0.40	1.922	1.951	1.917	2.113	1.523	2.530	1.232
2Y	1.960	-0.50	1.947	1.982	1.956	2.230	1.612	2.552	1.225
3Y	1.977	-0.30	1.954	1.994	1.985	2.315	1.677	2.595	1.200
4Y	2.072	-0.80	2.047	2.099	2.099	2.502	1.782	2.767	1.232
5Y	2.103	-1.20	2.084	2.142	2.161	2.602	1.847	2.830	1.217
7Y	2.201	-1.00	2.183	2.241	2.273	2.728	2.025	2.996	1.270
10Y	2.272	-0.80	2.254	2.311	2.348	2.815	2.115	3.148	1.355
20Y	2.219	-0.80	2.201	2.252	2.302	2.792	2.128	3.327	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.62	0.02	108.56	108.65	108.55
LKTb	124.22	0.09	123.85	124.27	123.85

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	-4.70	0.75	-7.13	-3.93	-2.12	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-5.25	0.15	-7.30	-5.42	-4.08	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-5.25	0.25	-6.57	-4.89	-4.69	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-2.45	0.05	-3.32	-1.97	-3.16	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-8.95	0.30	-9.32	-8.79	-10.66	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.30	0.70	-10.11	-9.95	-13.76	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-15.85	0.50	-16.53	-16.34	-21.00	-13.95	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.70	0.05	-17.27	-16.91	-22.02	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-7.90	0.05	-8.47	-7.29	-12.27	-5.50	-39.25	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1123.50 (+1.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-44.00	2.25	1Y	1.3950	2.00	1.6200	0.8250	1*2Y	-7.50	0.50		
-53.75	2.25	1.5Y	1.3350	2.00	1.6600	0.8800	2*3Y	-0.50	0.00		
-58.75	2.75	2Y	1.3200	2.50	1.6950	0.9300	2*5Y	5.50	-1.00		
-63.75	2.75	3Y	1.3150	2.50	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	0.00		
-65.75	3.00	4Y	1.3250	2.50	1.8000	1.0700	3*5Y	6.00	-1.00		
-63.50	2.00	5Y	1.3750	1.50	1.8500	1.1200	4*5Y	5.00	-1.00		
-60.25	2.00	7Y	1.4400	1.50	1.8950	1.1500	5*7Y	6.50	0.00		
-47.50	2.25	10Y	1.6300	1.50	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	2.9116	-0.0081	2.9197	2.8425	2.8588	2.9197	1.2620	2.9197	0.3100
10Y	3.2013	-0.0123	3.2136	3.1327	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	95.16	-0.31	95.47	91.05	91.98	95.47	-53.43	95.47	-210.20
10Y	92.93	-0.43	93.36	88.07	87.72	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	19.75	-0.50	20.25	20.25	20.25	42.50	19.00	62.75	2.75
KTb 2*10Y	31.20	-0.30	31.50	32.00	30.60	63.50	26.60	82.90	11.80
UST 2*10Y	28.97	-0.42	29.39	29.02	26.34	98.63	18.51	209.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS				ODD Tenor					
06M									
09M									
01Y	83.75								
1.5Y									
02Y				SPRD	3*5Y	06			
03Y	96.25				5*7Y	3.25			
04Y					5*10Y	9.5			
05Y	02				7*10Y	6.5			
07Y					5*7*10Y	9.5			
10Y	10.5								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	59 건	-40	99	98	112	169	134	165	
금 액	12,060 억원	-29,610	41,670	37,715	32,865	61,663	40,263	62,515	

장중동향
국고채 금리, 증시 움직임에 연동되며 금리 소폭 하락.
IRS, 금리 전구간 하락.
장중 채권시장 움직임에 연동되며 비드 우위.

CRS, 전구간 상승 마감.