

IPS Daily Morning Brief

2018-11-13

종가 기준일 2018-11-12

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7700	-0.50	1.7735	1.7783	1.7567	1.8075	1.4025	2.5600	1.2875
9M	1.8050	-0.50	1.8085	1.8115	1.8012	1.8500	1.4425	2.5250	1.2500
1Y	1.8225	-0.75	1.8310	1.8393	1.8315	1.9100	1.4825	2.5000	1.2200
1.5Y	1.8475	-1.00	1.8615	1.8756	1.8768	2.0250	1.5400	2.5000	1.1900
2Y	1.8700	-1.25	1.8895	1.9074	1.9088	2.1150	1.5725	2.5075	1.1675
3Y	1.9050	-1.25	1.9290	1.9461	1.9518	2.2225	1.6200	2.5800	1.1550
4Y	1.9350	-1.25	1.9595	1.9790	1.9894	2.2950	1.6625	2.6625	1.1575
5Y	1.9575	-1.75	1.9870	2.0088	2.0203	2.3400	1.6900	2.7250	1.1575
7Y	1.9875	-2.00	2.0190	2.0436	2.0588	2.3950	1.7300	2.8325	1.1675
10Y	2.0500	-2.00	2.0820	2.1073	2.1239	2.4850	1.8025	2.9750	1.2125
12Y	2.0800	-2.00	2.1120	2.1361	2.1591	2.5225	1.8325	3.0275	1.2150
15Y	2.0825	-2.00	2.1145	2.1384	2.1677	2.5400	1.8325	3.0725	1.2150
20Y	2.0875	-2.25	2.1215	2.1434	2.1739	2.5600	1.8325	3.1925	1.2150

6*9M	3.50	0.00	3.50	3.33	4.45	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	1.75	-0.25	2.25	2.78	3.03	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	4.75	-0.50	5.85	6.81	7.73	23.00	4.25	23.00	-5.50
2*3Y	3.50	0.00	3.95	3.88	4.30	13.25	3.25	13.25	-1.75
2*4Y	6.50	0.00	7.00	7.16	8.06	21.75	6.25	23.50	-1.75
2*5Y	8.75	-0.50	9.75	10.14	11.15	27.25	8.75	34.00	-1.75
3*4Y	3.00	0.00	3.05	3.29	3.76	8.50	3.00	11.25	-0.50
3*5Y	5.25	-0.50	5.80	6.26	6.85	14.00	5.25	22.00	-0.50
4*5Y	2.25	-0.50	2.75	2.98	3.09	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.00	-0.25	3.20	3.49	3.85	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.25	-0.25	9.50	9.85	10.35	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.00	6.30	6.36	6.50	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	2.89	3.53	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.25	0.00	3.25	3.11	4.38	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	-0.25	3.95	3.61	5.00	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.872	-0.50	1.874	1.886	1.854	1.935	1.400	2.446	1.237
1.5Y	1.924	0.00	1.921	1.933	1.917	2.113	1.523	2.453	1.232
2Y	1.945	0.00	1.950	1.964	1.953	2.230	1.625	2.492	1.225
3Y	1.946	-0.60	1.960	1.971	1.979	2.315	1.677	2.585	1.200
4Y	2.030	-1.00	2.052	2.067	2.093	2.502	1.789	2.767	1.232
5Y	2.045	-1.50	2.076	2.102	2.147	2.602	1.850	2.830	1.217
7Y	2.138	-1.50	2.172	2.201	2.257	2.728	2.025	2.996	1.270
10Y	2.210	-1.50	2.245	2.273	2.330	2.815	2.115	3.148	1.355
20Y	2.148	-1.40	2.186	2.215	2.282	2.792	2.128	3.327	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.50	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.75	0.06	108.74	108.76	108.70
LKTb	124.89	0.20	124.85	124.91	124.72

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	-4.95	-0.25	-4.30	-4.64	-2.23	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.65	-1.00	-5.93	-5.77	-4.01	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-7.50	-1.25	-6.05	-5.64	-4.43	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.10	-0.65	-3.12	-2.50	-2.76	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-9.50	-0.25	-9.23	-8.76	-10.31	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-8.75	-0.25	-8.94	-9.34	-12.70	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-15.05	-0.50	-15.28	-15.75	-19.81	-13.95	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.00	-0.50	-16.34	-16.56	-20.63	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-6.05	-0.85	-6.45	-7.16	-10.80	-5.20	-38.25	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1133.90 (+5.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-47.75	3.75	1Y	1.3450	3.00	1.6200	0.8400	1*2Y	-8.50	-1.50		
-54.25	3.00	1.5Y	1.3050	2.00	1.6600	0.8850	2*3Y	0.50	1.00		
-61.00	2.75	2Y	1.2600	1.50	1.6950	0.9200	2*5Y	6.00	1.00		
-64.00	3.75	3Y	1.2650	2.50	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	0.00		
-66.00	3.75	4Y	1.2750	2.50	1.8000	1.0700	3*5Y	5.50	0.00		
-63.75	4.25	5Y	1.3200	2.50	1.8500	1.1350	4*5Y	4.50	0.00		
-60.25	4.50	7Y	1.3850	2.50	1.8950	1.1700	5*7Y	6.50	0.00		
-47.50	4.50	10Y	1.5750	2.50	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	2.9282	0.0000	2.9282	2.9773	2.9567	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	3.1838	0.0000	3.1838	3.2382	3.2372	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	98.32	0	98.32	103.03	101.07	103.03	-53.43	103.03	-207.00
10Y	97.38	1.50	95.88	98.82	98.72	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	18.00	-0.75	18.75	19.25	19.75	42.50	18.00	62.75	2.75
KTb 2*10Y	26.50	-1.50	28.00	30.30	30.40	63.50	26.50	82.90	11.80
UST 2*10Y	25.56	0.00	25.56	26.09	28.05	98.63	18.51	205.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	82.5								
1.5Y									
02Y	87.25	SPRD							
03Y	91								
04Y	93.75								
05Y									
07Y									
10Y	5.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	50 건	-22	72	117	116	81	59	99	
금 액	12,445 억원	-11,230	23,675	44,072	44,084	24,795	12,060	41,670	

장중동향
 채권 금리하락 컵플래트닝.
 미국금리하락과 증시하락으로 강제 출발한 채권은 하락했다가 다시 주식이 하락하면서 상승 마감.

IRS도 레벨하락 컵 플래트닝.
 미국휴장으로 거래가 적고 한산한 분위기. 주식의 움직임에 따라 채권과 같이 움직임.

CRS는 전구간 상승마감.