

IPS Daily Morning Brief

2018-11-20

종가 기준일 2018-11-19

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7750	-0.50	1.7760	1.7738	1.7611	1.8075	1.4025	2.5600	1.2875
9M	1.8100	-0.50	1.8110	1.8051	1.8045	1.8500	1.4425	2.5125	1.2500
1Y	1.8325	-0.50	1.8315	1.8280	1.8343	1.9100	1.4825	2.4825	1.2200
1.5Y	1.8525	-0.75	1.8545	1.8591	1.8780	2.0250	1.5400	2.4825	1.1900
2Y	1.8650	-1.00	1.8735	1.8864	1.9090	2.1150	1.5875	2.4975	1.1675
3Y	1.8850	-1.50	1.9015	1.9224	1.9513	2.2225	1.6600	2.5800	1.1550
4Y	1.9150	-1.50	1.9310	1.9533	1.9883	2.2950	1.7100	2.6625	1.1575
5Y	1.9375	-1.75	1.9545	1.9808	2.0183	2.3400	1.7550	2.7250	1.1575
7Y	1.9700	-1.75	1.9855	2.0146	2.0557	2.3950	1.8075	2.8325	1.1675
10Y	2.0350	-2.00	2.0505	2.0789	2.1208	2.4850	1.8850	2.9750	1.2125
12Y	2.0650	-2.00	2.0805	2.1076	2.1554	2.5225	1.9175	3.0275	1.2150
15Y	2.0675	-2.00	2.0830	2.1096	2.1629	2.5400	1.9225	3.0725	1.2150
20Y	2.0625	-2.00	2.0810	2.1139	2.1681	2.5600	1.9325	3.1925	1.2150

6*9M	3.50	0.00	3.50	3.14	4.35	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	2.25	0.00	2.05	2.29	2.98	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	3.25	-0.50	4.20	5.84	7.47	23.00	3.25	23.00	-5.50
2*3Y	2.00	-0.50	2.80	3.60	4.23	13.25	2.00	13.25	-1.75
2*4Y	5.00	-0.50	5.75	6.69	7.93	21.75	5.00	23.50	-1.75
2*5Y	7.25	-0.75	8.10	9.44	10.93	27.25	7.25	34.00	-1.75
3*4Y	3.00	0.00	2.95	3.09	3.70	8.50	2.75	11.25	-0.50
3*5Y	5.25	-0.25	5.30	5.84	6.70	14.00	5.00	22.00	-0.50
4*5Y	2.25	-0.25	2.35	2.75	3.00	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.25	0.00	3.10	3.39	3.74	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.75	-0.25	9.60	9.81	10.25	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	-0.25	6.50	6.43	6.51	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	2.88	3.46	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.25	0.00	3.25	3.08	4.21	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	2.75	0.00	3.05	3.50	4.73	10.25	2.75	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.886	0.00	1.880	1.883	1.861	1.935	1.400	2.403	1.237
1.5Y	1.930	0.00	1.925	1.926	1.923	2.113	1.523	2.445	1.232
2Y	1.945	-0.50	1.938	1.951	1.955	2.230	1.625	2.492	1.225
3Y	1.940	-0.50	1.936	1.954	1.978	2.315	1.700	2.585	1.200
4Y	2.035	-1.50	2.037	2.047	2.091	2.502	1.830	2.767	1.232
5Y	2.042	-1.60	2.052	2.075	2.138	2.602	1.902	2.830	1.217
7Y	2.129	-1.90	2.140	2.170	2.244	2.728	2.083	2.996	1.270
10Y	2.197	-2.30	2.210	2.242	2.316	2.815	2.160	3.148	1.355
20Y	2.170	-0.20	2.159	2.189	2.266	2.792	2.128	3.327	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.51	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.76	0.04	108.77	108.80	108.74
LKTb	124.99	0.23	124.91	125.12	124.85

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	-5.35	-0.50	-4.85	-5.51	-2.70	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.75	-0.75	-7.01	-6.65	-4.48	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-8.00	-0.50	-6.49	-6.44	-4.63	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-5.50	-1.00	-3.49	-3.19	-2.66	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-12.00	0.00	-10.62	-9.41	-10.29	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.45	-0.15	-9.79	-9.40	-11.95	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-15.90	0.15	-15.47	-15.58	-18.86	-13.95	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.20	0.30	-15.97	-16.32	-19.50	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-10.75	-1.80	-7.84	-7.53	-9.82	-5.20	-38.25	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1128.60 (+0.10)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-62.25	-3.50	1Y	1.2100	-4.00	1.6200	0.8600	1*2Y	-3.50	3.50
-65.75	-1.75	1.5Y	1.1950	-2.50	1.6600	0.9050	2*3Y	1.50	0.50
-69.00	0.50	2Y	1.1750	-0.50	1.6950	0.9200	2*5Y	6.50	0.50
-69.50	1.50	3Y	1.1900	0.00	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	0.00
-71.50	1.50	4Y	1.2000	0.00	1.8000	1.0700	3*5Y	5.00	0.00
-69.75	1.75	5Y	1.2400	0.00	1.8500	1.1350	4*5Y	4.00	0.00
-66.50	1.75	7Y	1.3050	0.00	1.8950	1.2150	5*7Y	6.50	0.00
-54.00	2.00	10Y	1.4950	0.00	2.0500	1.3400	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	2.7872	-0.0167	2.8039	2.8622	2.8705	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	3.0692	0.0045	3.0647	3.1140	3.1250	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	84.22	-1.17	85.39	92.22	94.55	103.03	-53.43	103.03	-207.00
10Y	87.22	2.75	84.47	88.40	92.80	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	17.00	-1.00	18.00	19.00	17.25	42.50	17.00	62.75	2.75
KTb 2*10Y	25.20	-1.80	27.00	29.00	27.20	63.50	25.20	82.90	11.80
UST 2*10Y	28.20	2.12	26.08	25.18	25.45	98.63	18.51	205.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	85								
02Y		SPRD	2*3Y 02						
03Y	88.5 / 88.25								
04Y	91.25								
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y CCS 21								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	52 건	-57	109	92	82	89	50	72	
금 액	13,700 억원	-14,678	28,378	35,130	49,355	22,948	12,445	23,675	

장종동향
 국고채 금리, 장단기 위주 금리 하락.
 IRS, 전 구간 금리 하락. 커브 플랫트닝.
 한산한 가운데 거래량 많지 않음.

CRS, 2Y 이하 구간 금리 하락 & 3Y 이상 구간 보합 마감.