

IPS Daily Morning Brief

2018-11-23

종가 기준일 2018-11-22

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7750	-0.25	1.7770	1.7711	1.7641	1.8075	1.4025	2.5450	1.2875
9M	1.8075	-0.50	1.8115	1.8023	1.8064	1.8500	1.4425	2.5025	1.2500
1Y	1.8250	-1.00	1.8330	1.8230	1.8358	1.9100	1.4825	2.4725	1.2200
1.5Y	1.8475	-1.00	1.8545	1.8514	1.8782	2.0250	1.5400	2.4825	1.1900
2Y	1.8650	-1.00	1.8695	1.8760	1.9083	2.1150	1.5875	2.4975	1.1675
3Y	1.8950	-0.75	1.8950	1.9103	1.9498	2.2225	1.6600	2.5800	1.1550
4Y	1.9250	-0.75	1.9245	1.9409	1.9864	2.2950	1.7100	2.6625	1.1575
5Y	1.9475	-0.75	1.9475	1.9669	2.0158	2.3400	1.7550	2.7250	1.1575
7Y	1.9800	-0.75	1.9800	2.0000	2.0527	2.3950	1.8075	2.8325	1.1675
10Y	2.0450	-0.75	2.0460	2.0641	2.1180	2.4850	1.8850	2.9750	1.2125
12Y	2.0750	-0.75	2.0760	2.0933	2.1523	2.5225	1.9175	3.0275	1.2150
15Y	2.0850	-0.25	2.0810	2.0963	2.1594	2.5400	1.9225	3.0725	1.2150
20Y	2.0800	-0.25	2.0760	2.0988	2.1638	2.5600	1.9325	3.1925	1.2150

6*9M	3.25	-0.25	3.45	3.11	4.23	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	1.75	-0.50	2.15	2.08	2.94	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	4.00	0.00	3.65	5.30	7.26	23.00	3.25	23.00	-5.50
2*3Y	3.00	0.25	2.55	3.43	4.15	13.25	2.00	13.25	-1.75
2*4Y	6.00	0.25	5.50	6.49	7.80	21.75	5.00	23.50	-1.75
2*5Y	8.25	0.25	7.80	9.09	10.74	27.25	7.25	34.00	-1.75
3*4Y	3.00	0.00	2.95	3.06	3.65	8.50	2.75	11.25	-0.50
3*5Y	5.25	0.00	5.25	5.66	6.59	14.00	5.00	22.00	-0.50
4*5Y	2.25	0.00	2.30	2.60	2.94	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.25	0.00	3.25	3.31	3.69	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.75	0.00	9.85	9.73	10.23	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.60	6.41	6.53	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	2.91	3.43	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.50	3.50	3.21	4.14	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	0.50	3.00	3.46	4.58	10.25	2.75	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.894	-0.20	1.892	1.882	1.866	1.935	1.400	2.385	1.237
1.5Y	1.934	-0.40	1.934	1.924	1.926	2.113	1.523	2.445	1.232
2Y	1.947	-0.30	1.948	1.945	1.957	2.230	1.625	2.492	1.225
3Y	1.935	-1.20	1.941	1.946	1.976	2.315	1.707	2.585	1.200
4Y	2.025	-1.20	2.036	2.039	2.089	2.502	1.830	2.767	1.232
5Y	2.070	2.00	2.053	2.064	2.132	2.602	1.905	2.830	1.217
7Y	2.133	-0.70	2.137	2.157	2.236	2.728	2.083	2.996	1.270
10Y	2.205	-0.50	2.207	2.229	2.308	2.815	2.160	3.148	1.355
20Y	2.165	-0.20	2.168	2.178	2.258	2.792	2.128	3.327	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.52	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.78	0.04	108.75	108.78	108.74
LKTb	124.93	0.05	124.98	125.02	124.90

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-6.90	-0.80	-5.86	-5.94	-2.98	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-8.65	-0.60	-7.95	-7.30	-4.78	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-8.20	-0.70	-7.83	-6.91	-4.85	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.00	0.45	-4.64	-3.62	-2.65	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-10.00	0.45	-11.19	-9.82	-10.30	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.25	-2.75	-10.59	-9.75	-11.62	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-15.30	-0.05	-15.72	-15.75	-18.38	-13.95	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.00	-0.25	-16.14	-16.49	-19.00	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-8.50	-0.05	-9.18	-7.93	-9.45	-5.20	-38.00	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1129.20 (-2.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-63.50	1.50	1Y	1.1900	0.50	1.6200	0.8600	1*2Y	-3.00	-0.50		
-67.25	1.00	1.5Y	1.1750	0.00	1.6600	0.9050	2*3Y	2.00	-0.50		
-70.50	1.00	2Y	1.1600	0.00	1.6950	0.9200	2*5Y	1.50	-1.00		
-71.50	0.25	3Y	1.1800	-0.50	1.7550	0.9850	3*4Y	-2.00	-0.50		
-76.50	-0.25	4Y	1.1600	-1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-0.50	-0.50		
-77.25	-0.25	5Y	1.1750	-1.00	1.8500	1.1350	4*5Y	1.50	0.00		
-74.50	-0.25	7Y	1.2350	-1.00	1.8950	1.2150	5*7Y	6.00	0.00		
-62.00	-0.25	10Y	1.4250	-1.00	2.0500	1.3450	5*10Y	25.00	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	2.8118	0.0000	2.8118	2.8079	2.7872	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	3.0637	0.0000	3.0637	3.0637	3.0692	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	86.48	0.3	86.18	86.09	84.22	103.03	-53.43	103.03	-207.00
10Y	85.87	0.50	85.37	85.87	87.22	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	0.25	17.75	17.50	17.00	42.50	17.00	62.75	2.75
KTb 2*10Y	25.80	-0.20	26.00	25.80	25.20	63.50	25.20	82.90	11.80
UST 2*10Y	25.19	0.00	25.19	25.58	28.20	98.63	18.51	205.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	77.25 / 77.5									
09M										
01Y	83									
1.5Y	86.5 / 86.75 / 87									
02Y	89.5 / 89.75				SPRD	3*8y 10.75				
03Y						10*15y 04				
04Y										
05Y	17									
07Y										
10Y										
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	5y 17									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			64 건	-32	96	70	52	109	92	82
금 액			21,720 억원	-3,739	25,459	27,815	13,700	28,378	35,130	49,355

장중동향
 국고채 금리하락.
 금통위를 앞두고 국내재료가 부진한 가운데 미국 추수감사절 연휴가 겹치며 거래량 급감. 전일되돌림과 외국인매수로 채권 강보합 마감.

IRS는 전구간 레벨 하락.
 단기부터 2년구간까지는 커브가 플랫되고, 장기까지는 소폭 스텝 마감.

CRS는 3년부터 하락하며 커브 플랫마감.