

IPS Daily Morning Brief

2018-11-27

종가 기준일 2018-11-26

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7775	0.00	1.7770	1.7731	1.7656	1.8075	1.4025	2.5375	1.2875
9M	1.8050	0.00	1.8085	1.8050	1.8076	1.8500	1.4425	2.5000	1.2500
1Y	1.8200	0.00	1.8270	1.8258	1.8368	1.9100	1.4825	2.4725	1.2200
1.5Y	1.8375	0.00	1.8470	1.8530	1.8786	2.0250	1.5400	2.4825	1.1900
2Y	1.8550	0.25	1.8630	1.8769	1.9085	2.1150	1.5875	2.4975	1.1675
3Y	1.8775	0.25	1.8885	1.9100	1.9495	2.2225	1.6600	2.5800	1.1550
4Y	1.9050	0.25	1.9170	1.9404	1.9856	2.2950	1.7100	2.6625	1.1575
5Y	1.9250	0.25	1.9385	1.9656	2.0145	2.3400	1.7550	2.7250	1.1575
7Y	1.9575	0.25	1.9710	1.9983	2.0510	2.3950	1.8075	2.8325	1.1675
10Y	2.0150	0.25	2.0335	2.0619	2.1161	2.4850	1.8850	2.9750	1.2125
12Y	2.0450	0.25	2.0635	2.0913	2.1501	2.5225	1.9175	3.0275	1.2150
15Y	2.0550	0.25	2.0715	2.0951	2.1573	2.5400	1.9225	3.0725	1.2150
20Y	2.0475	0.25	2.0655	2.0961	2.1611	2.5600	1.9325	3.1925	1.2150

6*9M	2.75	0.00	3.15	3.19	4.20	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	1.50	0.00	1.85	2.08	2.93	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	3.50	0.25	3.60	5.11	7.17	23.00	3.25	23.00	-5.50
2*3Y	2.25	0.00	2.55	3.31	4.09	13.25	2.00	13.25	-1.75
2*4Y	5.00	0.00	5.40	6.35	7.71	21.75	5.00	23.50	-1.75
2*5Y	7.00	0.00	7.55	8.88	10.60	27.25	7.00	34.00	-1.75
3*4Y	2.75	0.00	2.85	3.04	3.62	8.50	2.75	11.25	-0.50
3*5Y	4.75	0.00	5.00	5.56	6.50	14.00	4.75	22.00	-0.50
4*5Y	2.00	0.00	2.15	2.53	2.89	6.00	2.00	10.75	-0.25
5*7Y	3.25	0.00	3.25	3.26	3.65	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.00	0.00	9.50	9.63	10.16	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	5.75	0.00	6.25	6.36	6.51	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	2.94	3.40	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	3.80	3.32	4.11	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.25	0.00	3.20	3.42	4.50	10.25	2.75	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.885	-1.00	1.893	1.883	1.869	1.935	1.400	2.385	1.237
1.5Y	1.929	-0.30	1.934	1.925	1.929	2.113	1.523	2.445	1.232
2Y	1.935	-0.20	1.943	1.945	1.959	2.230	1.625	2.492	1.225
3Y	1.915	0.30	1.930	1.945	1.976	2.315	1.707	2.585	1.200
4Y	2.000	0.50	2.018	2.039	2.089	2.502	1.830	2.767	1.232
5Y	2.010	0.30	2.031	2.061	2.128	2.602	1.905	2.830	1.217
7Y	2.099	0.30	2.121	2.154	2.232	2.728	2.083	2.996	1.270
10Y	2.170	0.50	2.191	2.225	2.303	2.815	2.160	3.148	1.355
20Y	2.122	0.00	2.148	2.174	2.254	2.792	2.122	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	108.88	0.00	108.88	108.90	108.84
LKTb	125.32	-0.01	125.34	125.38	125.20

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	-6.50	1.00	-6.62	-5.73	-3.26	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-9.15	0.30	-8.72	-7.24	-5.04	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-8.00	0.45	-8.02	-6.78	-5.04	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-3.75	-0.05	-4.13	-3.52	-2.67	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-9.50	-0.25	-10.14	-9.83	-10.34	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-8.50	-0.05	-9.23	-9.52	-11.38	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-14.15	-0.05	-14.98	-15.57	-18.08	-13.95	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-15.50	-0.25	-15.75	-16.33	-18.73	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-7.45	0.25	-8.27	-7.76	-9.24	-5.20	-36.00	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1128.90 (-1.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-58.50	3.00	1Y	1.2350	3.00	1.6200	0.8600	1*2Y	-4.00	-1.00	
-62.25	2.50	1.5Y	1.2150	2.50	1.6600	0.9050	2*3Y	1.50	0.00	
-66.00	1.75	2Y	1.1950	2.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-1.50	0.00	
-66.75	1.75	3Y	1.2100	2.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-2.50	0.00	
-72.00	1.75	4Y	1.1850	2.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-3.00	0.00	
-74.50	1.75	5Y	1.1800	2.00	1.8500	1.1350	4*5Y	-0.50	0.00	
-71.75	1.75	7Y	1.2400	2.00	1.8950	1.2150	5*7Y	6.00	0.00	
-58.50	1.75	10Y	1.4300	2.00	2.0500	1.3500	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	2.8407	0.0209	2.8198	2.8118	2.8118	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	3.0572	0.0173	3.0399	3.0637	3.0637	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	90.57	2.29	88.28	86.48	86.18	103.03	-53.43	103.03	-207.00
10Y	88.72	1.23	87.49	85.87	85.37	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	16.00	0.00	16.00	18.00	17.75	42.50	16.00	62.75	2.75
KTb 2*10Y	23.50	0.70	22.80	25.80	26.00	63.50	22.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	21.65	-0.36	22.01	25.19	25.19	98.63	18.51	205.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M	77.75								
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	86 / 88								
03Y									
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	41 건	-103	144	64	96	70	52	109	
금 액	11,016 억원	-29,526	40,542	21,720	25,459	27,815	13,700	28,378	

장중동향
국고채 금리 보합.
미국채는 안전자산 선호로 금리 하락했지만 국내 채권은 금통위 대기와 관망으로 보합권에서 혼조 마감.

IRS 소폭상승.
금통위 부담으로 거래 제한적. 거래없이 관망세.

CRS 전구간 상승.