

IPS Daily Morning Brief

2018-11-28

종가 기준일 2018-11-27

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7775	0.00	1.7770	1.7741	1.7663	1.8075	1.4025	2.5325	1.2875
9M	1.8050	0.00	1.8070	1.8064	1.8080	1.8500	1.4425	2.4950	1.2500
1Y	1.8200	0.00	1.8240	1.8270	1.8372	1.9100	1.4825	2.4700	1.2200
1.5Y	1.8350	-0.25	1.8430	1.8535	1.8786	2.0250	1.5400	2.4825	1.1900
2Y	1.8500	-0.50	1.8595	1.8770	1.9084	2.1150	1.5875	2.4975	1.1675
3Y	1.8700	-0.75	1.8840	1.9094	1.9490	2.2225	1.6600	2.5800	1.1550
4Y	1.8975	-0.75	1.9125	1.9395	1.9850	2.2950	1.7100	2.6625	1.1575
5Y	1.9175	-0.75	1.9335	1.9644	2.0136	2.3400	1.7550	2.7250	1.1575
7Y	1.9500	-0.75	1.9660	1.9969	2.0500	2.3950	1.8075	2.8325	1.1675
10Y	2.0075	-0.75	2.0265	2.0601	2.1148	2.4850	1.8850	2.9750	1.2125
12Y	2.0375	-0.75	2.0565	2.0896	2.1488	2.5225	1.9175	3.0275	1.2150
15Y	2.0525	-0.25	2.0665	2.0941	2.1559	2.5400	1.9225	3.0725	1.2150
20Y	2.0425	-0.50	2.0595	2.0944	2.1595	2.5600	1.9325	3.1925	1.2150

6*9M	2.75	0.00	3.00	3.23	4.18	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	1.50	0.00	1.70	2.06	2.92	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	3.00	-0.50	3.55	5.00	7.12	23.00	3.00	23.00	-5.50
2*3Y	2.00	-0.25	2.45	3.24	4.06	13.25	2.00	13.25	-1.75
2*4Y	4.75	-0.25	5.30	6.25	7.66	21.75	4.75	23.50	-1.75
2*5Y	6.75	-0.25	7.40	8.74	10.52	27.25	6.75	34.00	-1.75
3*4Y	2.75	0.00	2.85	3.01	3.60	8.50	2.75	11.25	-0.50
3*5Y	4.75	0.00	4.95	5.50	6.46	14.00	4.75	22.00	-0.50
4*5Y	2.00	0.00	2.10	2.49	2.86	6.00	2.00	10.75	-0.25
5*7Y	3.25	0.00	3.25	3.25	3.63	7.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.00	0.00	9.30	9.58	10.12	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	5.75	0.00	6.05	6.33	6.49	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	2.95	3.39	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.50	4.00	3.40	4.11	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	0.25	3.30	3.42	4.46	10.25	2.75	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.881	-0.40	1.890	1.883	1.871	1.935	1.400	2.385	1.237
1.5Y	1.926	-0.30	1.932	1.926	1.931	2.113	1.523	2.445	1.232
2Y	1.927	-0.80	1.939	1.944	1.960	2.230	1.625	2.492	1.225
3Y	1.907	-0.80	1.923	1.944	1.976	2.315	1.707	2.585	1.200
4Y	1.991	-0.90	2.010	2.038	2.089	2.502	1.830	2.767	1.232
5Y	1.992	-1.80	2.020	2.058	2.126	2.602	1.905	2.830	1.217
7Y	2.080	-1.90	2.110	2.150	2.229	2.728	2.080	2.996	1.270
10Y	2.151	-1.90	2.180	2.222	2.301	2.815	2.151	3.148	1.355
20Y	2.112	-1.00	2.138	2.171	2.251	2.792	2.112	3.327	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.49	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.92	0.04	108.88	108.93	108.88
LKTB	125.50	0.18	125.31	125.56	125.23

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	-6.10	0.40	-6.62	-5.58	-3.43	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-9.10	0.05	-8.88	-7.22	-5.19	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-7.70	0.30	-7.97	-6.71	-5.13	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-3.70	0.05	-3.92	-3.45	-2.70	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-9.35	0.15	-9.71	-9.83	-10.37	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-7.45	1.05	-8.63	-9.38	-11.27	-7.45	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-13.00	1.15	-14.36	-15.36	-17.93	-13.00	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-14.35	1.15	-15.37	-16.15	-18.60	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-6.95	0.50	-7.81	-7.63	-9.17	-5.20	-36.00	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS				USD/KRW		1129.40 (+0.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-56.50	2.00	1Y	1.2550	2.00	1.6200	0.8600	1*2Y	-3.00	1.00
-59.50	2.75	1.5Y	1.2400	2.50	1.6600	0.9050	2*3Y	1.50	0.00
-62.50	3.50	2Y	1.2250	3.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-1.50	0.00
-63.00	3.75	3Y	1.2400	3.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-2.50	0.00
-68.25	3.75	4Y	1.2150	3.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-3.00	0.00
-70.75	3.75	5Y	1.2100	3.00	1.8500	1.1350	4*5Y	-0.50	0.00
-68.00	3.75	7Y	1.2700	3.00	1.8950	1.2150	5*7Y	6.00	0.00
-54.75	3.75	10Y	1.4600	3.00	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	2.8307	-0.0100	2.8407	2.8198	2.8118	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	3.0617	0.0045	3.0572	3.0399	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	90.37	-0.2	90.57	88.28	86.48	103.03	-53.43	103.03	-207.00
10Y	91.07	2.35	88.72	87.49	85.87	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	15.75	-0.25	16.00	16.00	18.00	42.50	15.75	62.75	2.75
KTb 2*10Y	22.40	-1.10	23.50	22.80	25.80	63.50	22.40	82.90	11.80
UST 2*10Y	23.10	1.45	21.65	22.01	25.19	98.11	18.51	205.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	81.75								
1.5Y	83.25 / 83.75								
02Y		SPRD	9*12M 1.5						
03Y	87.25		1.5*4Y 06						
04Y	89.5 / 89.75								
05Y	92								
07Y									
10Y	0.75 / 01								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y CCS 24 / 24.5 / 25								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	69 건	28	41	144	64	96	70	52	
금 액	22,155 억원	11,139	11,016	40,542	21,720	25,459	27,815	13,700	

장중동향
국고채 금리, 외인의 3년, 10년 국채선물 대량 매수 영향으로 금리 하락 마감.
한편 국고 5년 비지표물 14-1호와 14-4호에 대한 대차상환(리콜) 요구에 장중 한때 14-1호 금리는 기준금리보다 낮은 수준에서 거래되기도.

IRS, 1.5Y 이상 구간에서 금리 하락.
국채선물에 연동한 모습이었으나 비드가 많이 나와 상대적으로 강세가 완만. 기준금리 인상을 앞두고 CD금리 상승 우려가 일부 반영.
CRS, 전 구간 금리 상승.