

IPS Daily Morning Brief

2018-11-29

종가 기준일 2018-11-28

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7800	0.25	1.7775	1.7753	1.7671	1.8075	1.4025	2.5325	1.2875
9M	1.8125	0.75	1.8070	1.8079	1.8089	1.8500	1.4425	2.4950	1.2500
1Y	1.8300	1.00	1.8230	1.8285	1.8380	1.9100	1.4825	2.4700	1.2200
1.5Y	1.8550	2.00	1.8425	1.8545	1.8793	2.0250	1.5400	2.4825	1.1900
2Y	1.8750	2.50	1.8595	1.8773	1.9091	2.1150	1.5875	2.4975	1.1675
3Y	1.8950	2.50	1.8825	1.9089	1.9493	2.2225	1.6600	2.5800	1.1550
4Y	1.9200	2.25	1.9100	1.9385	1.9851	2.2950	1.7100	2.6625	1.1575
5Y	1.9400	2.25	1.9305	1.9629	2.0136	2.3400	1.7550	2.7250	1.1575
7Y	1.9675	1.75	1.9620	1.9949	2.0497	2.3950	1.8075	2.8325	1.1675
10Y	2.0400	3.25	2.0240	2.0585	2.1149	2.4850	1.8850	2.9750	1.2125
12Y	2.0700	3.25	2.0540	2.0881	2.1487	2.5225	1.9175	3.0275	1.2150
15Y	2.0850	3.25	2.0660	2.0933	2.1559	2.5400	1.9225	3.0725	1.2150
20Y	2.0750	3.25	2.0580	2.0928	2.1591	2.5600	1.9325	3.1925	1.2150

6*9M	3.25	0.50	2.95	3.26	4.18	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	1.75	0.25	1.60	2.06	2.92	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	4.50	1.50	3.65	4.88	7.10	23.00	3.00	23.00	-5.50
2*3Y	2.00	0.00	2.30	3.16	4.03	13.25	2.00	13.25	-1.75
2*4Y	4.50	-0.25	5.05	6.13	7.60	21.75	4.50	23.50	-1.75
2*5Y	6.50	-0.25	7.10	8.56	10.45	27.25	6.50	34.00	-1.75
3*4Y	2.50	-0.25	2.75	2.96	3.58	8.50	2.50	11.25	-0.50
3*5Y	4.50	-0.25	4.80	5.40	6.43	14.00	4.50	22.00	-0.50
4*5Y	2.00	0.00	2.05	2.44	2.85	6.00	2.00	10.75	-0.25
5*7Y	2.75	-0.50	3.15	3.20	3.61	7.25	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	1.00	9.35	9.56	10.13	17.00	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.25	1.50	6.20	6.36	6.52	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	2.96	3.38	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.00	4.20	3.48	4.10	6.75	2.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	0.00	3.40	3.42	4.42	10.25	2.75	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.882	0.10	1.887	1.883	1.874	1.935	1.400	2.385	1.237
1.5Y	1.930	0.40	1.930	1.926	1.932	2.113	1.523	2.445	1.232
2Y	1.940	1.30	1.937	1.944	1.961	2.230	1.625	2.492	1.225
3Y	1.915	0.80	1.917	1.943	1.976	2.315	1.707	2.585	1.200
4Y	2.002	1.10	2.003	2.036	2.089	2.502	1.830	2.767	1.232
5Y	2.002	1.00	2.010	2.055	2.125	2.602	1.905	2.830	1.217
7Y	2.086	0.60	2.099	2.146	2.227	2.728	2.080	2.996	1.270
10Y	2.152	0.10	2.169	2.217	2.299	2.815	2.151	3.148	1.355
20Y	2.116	0.40	2.127	2.167	2.250	2.792	2.112	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	108.88	-0.04	108.90	108.92	108.85
LKTb	125.48	-0.02	125.50	125.55	125.39

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	-5.20	0.90	-6.44	-5.40	-3.55	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.50	1.60	-8.77	-7.17	-5.30	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-6.50	1.20	-7.77	-6.69	-5.20	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-2.00	1.70	-3.43	-3.37	-2.69	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-8.20	1.15	-9.26	-9.76	-10.38	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-6.20	1.25	-7.97	-9.16	-11.15	-6.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-11.85	1.15	-13.68	-15.12	-17.77	-11.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-11.20	3.15	-14.46	-15.85	-18.40	-11.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-4.10	2.85	-6.94	-7.42	-9.06	-4.10	-36.00	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1126.50 (-2.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-59.00	-2.50	1Y	1.2400	-1.50	1.6200	0.8600	1*2Y	-3.00	0.00	
-63.00	-3.50	1.5Y	1.2250	-1.50	1.6600	0.9050	2*3Y	2.00	0.50	
-66.50	-4.00	2Y	1.2100	-1.50	1.6950	0.9200	2*5Y	-1.00	0.50	
-66.50	-3.50	3Y	1.2300	-1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-2.50	0.00	
-71.50	-3.25	4Y	1.2050	-1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-3.00	0.00	
-74.00	-3.25	5Y	1.2000	-1.00	1.8500	1.1350	4*5Y	-0.50	0.00	
-70.75	-2.75	7Y	1.2600	-1.00	1.8950	1.2150	5*7Y	6.00	0.00	
-59.00	-4.25	10Y	1.4500	-1.00	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	2.8147	-0.0160	2.8307	2.8407	2.8198	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	3.0590	-0.0027	3.0617	3.0572	3.0399	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	87.47	-2.9	90.37	90.57	88.28	103.03	-53.43	103.03	-207.00
10Y	90.70	-0.37	91.07	88.72	87.49	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	16.50	0.75	15.75	16.00	16.00	42.50	15.75	62.75	2.75
KTb 2*10Y	21.20	-1.20	22.40	23.50	22.80	63.50	21.20	82.90	11.80
UST 2*10Y	24.43	1.33	23.10	21.65	22.01	98.11	18.51	205.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor	6y 95.25 / 95.5			
06M	78								
09M	81.25								
01Y	82.75 / 83								
1.5Y	85 / 85.25								
02Y	86 / 86.75 / 87								
03Y	88.75 / 89 / 89.25				SPRD	9*12m 1.5			
04Y	91.5 / 92					1*1.5y 2.5			
05Y	93.25 / 93.5 / 93.75					2*3y 02 / 2.25			
07Y	96.25 / 96.75					3*5y 4.25			
10Y	01 / 03 / 04					4*5y 02			
12Y						5*10y 09 / 9.25			
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	139 건		70	69	41	144	64	96	70
금 액	55,220 억원		33,065	22,155	11,016	40,542	21,720	25,459	27,815

장중동향
 국고채 금리 상승.
 금통위를 앞두고 눈치보기 장세가 이어지는 가운데 외국인의 매도로 약보합 마감.

IRS는 채권에 비해 뚜렷한 약세를 보였고 중단기 구간으로 비드가 나오면서 레벨 상승.

CRS는 전 구간 하락 마감.