IPS Daily Morning Brief

2018-10-02

종가 기준일 2018-10-01

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7700	1.00	1.7565	1.7440	1.7327	1.7700	1.3900	2.6525	1.2875
9M	1.8275	1.00	1.8130	1.7893	1.7836	1.8300	1.4100	2.6625	1.2500
1Y	1.8675	1.25	1.8525	1.8184	1.8186	1.9100	1.4350	2.6725	1.2200
1.5Y	1.9250	1.75	1.9060	1.8616	1.8756	2.0250	1.4700	2.7200	1.1900
2Y	1.9625	2.25	1.9415	1.8899	1.9148	2.1150	1.5000	2.7675	1.1675
3Y	2.0075	2.50	1.9900	1.9348	1.9684	2.2225	1.5550	2.8500	1.1550
4Y	2.0450	3.00	2.0310	1.9741	2.0114	2.2950	1.6050	2.9200	1.1575
5Y	2.0725	3.25	2.0600	2.0035	2.0460	2.3400	1.6475	2.9775	1.1575
7Y	2.1050	3.75	2.0950	2.0445	2.0872	2.3950	1.7050	3.0675	1.1675
10Y	2.1650	3.25	2.1610	2.1110	2.1514	2.4850	1.7825	3.1875	1.2125
12Y	2.2050	3.25	2.2010	2.1506	2.1904	2.5225	1.8175	3.2300	1.2150
15Y	2.2150	3.00	2.2130	2.1630	2.2081	2.5400	1.8250	3.2675	1.2150
20Y	2.2200	3.00	2.2190	2.1709	2.2196	2.5600	1.8250	3.3875	1.2150

6*9M	5.75	0.00	5.65	4.53	5.09	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	4.00	0.25	3.95	2.91	3.50	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	9.50	1.00	8.90	7.15	9.62	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	4.50	0.25	4.85	4.49	5.36	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	8.25	0.75	8.95	8.43	9.66	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	11.00	1.00	11.85	11.36	13.12	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	3.75	0.50	4.10	3.94	4.30	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	6.50	0.75	7.00	6.88	7.76	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	2.75	0.25	2.90	2.94	3.45	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.25	0.50	3.50	4.10	4.12	8.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.25	0.00	10.10	10.75	10.55	20.00	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.00	-0.50	6.60	6.65	6.43	11.50	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.96	3.90	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.00	-0.25	5.20	5.20	5.67	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	5.50	-0.25	5.80	5.99	6.82	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.891	0.00	1.887	1.832	1.831	1.935	1.400	2.668	1.237
1.5Y	1.948	0.10	1.947	1.895	1.914	2.113	1.517	2.716	1.232
2Y	1.995	1.50	1.983	1.930	1.969	2.230	1.577	2.780	1.225
3Y	2.015	1.30	2.010	1.965	2.018	2.315	1.617	2.837	1.200
4Y	2.150	2.00	2.155	2.096	2.135	2.502	1.760	2.952	1.232
5Y	2.195	2.00	2.198	2.145	2.231	2.602	1.830	3.070	1.217
7Y	2.303	2.30	2.308	2.261	2.354	2.728	2.024	3.160	1.270
10Y	2.380	2.50	2.384	2.333	2.437	2.815	2.115	3.380	1.355
20Y	2.357	2.20	2.360	2.286	2.408	2.792	2.176	3.530	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.55	-10.50

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.33	-0.05	108.36	108.38	108.28
LKTB	122.96	-0.24	123.09	123.12	122.80

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-2.35	1.25	-3.43	-1.34	-1.26	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-2.30	1.65	-4.08	-3.32	-3.87	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-3.25	0.75	-4.13	-4.04	-5.44	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-0.75	1.20	-1.98	-3.04	-5.00	-0.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-10.50	1.00	-12.38	-12.14	-12.38	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.25	1.25	-13.84	-14.19	-18.52	-12.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-19.80	1.45	-21.34	-21.68	-26.63	-19.80	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-21.50	0.75	-22.30	-22.20	-28.60	-20.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-13.70	0.80	-14.08	-11.54	-18.80	-7.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-44.25	0.25
-55.50	-0.25
-62.25	-0.75
-66.75	-1.00
-68.50	-1.50
-65.75	-1.75
-65.00	-2.25
-51.50	-1.75

CRS

USD/KRW 1111.80 (+2.50)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.4250	1.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-8.50	0.00
1.5Y	1.3700	1.50	1.6600	0.8600	2*3Y	0.00	0.00
2Y	1.3400	1.50	1.6950	0.9250	2*5Y	7.50	0.00
3Y	1.3400	1.50	1.7550	0.9850	3*4Y	2.00	0.00
4Y	1.3600	1.50	1.8000	1.0700	3*5Y	7.50	0.00
5Y	1.4150	1.50	1.8500	1.0800	4*5Y	5.50	0.00
7Y	1.4550	1.50	1.8950	1.1050	5*7Y	4.00	0.00
10Y	1.6500	1.50	2.0500	1.2200	5*10Y	23.50	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	2.8230	0.0163	2.8067	2.8308	2.8307	2.8427	1.2458	2.8427	0.3100
10Y	3.0830	0.0215	3.0615	3.0540	3.0474	3.1131	2.0387	3.1131	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	82.80	0.13	82.67	85.58	84.87	88.61	-53.43	88.61	-238.00
10Y	70.30	-0.35	70.65	68.90	63.74	72.24	-24.46	72.24	-79.00

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	20.25	1.00	19.25	20.75	24.75	42.50	19.25	62.75	2.75
KTB 2*10Y	38.50	1.00	37.50	39.00	42.80	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	26.00	0.52	25.48	22.32	21.67	105.58	18.51	221.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	9Y 14
06M	77.25		
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	94.5 / 95 / 94.75	SPRD	6M*3Y 23.5
03Y	0.75 / 99.75		1*2Y 8.75
04Y	3.75		
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1.5Y CCS 37		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	97 건	-58	155	101	0	0	165
금 액	29,240 억원	-24,722	53,962	41,860	0,000	0,000	0,000	46,257

장중동향

국고채 금리, 한은 금통위 경계심 & 외인의 국채선물 순매도 전환 영향으로 금리 상승.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.
외인 국채 선물 매도와 NAFTA 타결 소식 영향으로 전 구간 비드가 우위. 주로 오퍼가 테이큰되며 거래.

CRS, 전 구간 고르게 금리 상승.
양쪽 수요는 일부 있었으나 거래는 활발하지 않음.