IPS Daily Morning Brief

2018-10-10

종가 기준일 2018-10-08

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7725	0.00	1.7690	1.7533	1.7380	1.7725	1.3900	2.6325	1.2875
9M	1.8400	0.00	1.8320	1.8060	1.7884	1.8400	1.4100	2.6300	1.2500
1Y	1.8850	0.00	1.8745	1.8415	1.8230	1.9100	1.4350	2.6300	1.2200
1.5Y	1.9625	0.00	1.9460	1.8936	1.8799	2.0250	1.4700	2.6600	1.1900
2Y	2.0075	0.00	1.9860	1.9268	1.9182	2.1150	1.5000	2.6875	1.1675
3Y	2.0650	0.00	2.0380	1.9746	1.9703	2.2225	1.5550	2.7600	1.1550
4Y	2.1100	0.00	2.0800	2.0155	2.0133	2.2950	1.6050	2.8325	1.1575
5Y	2.1425	0.00	2.1105	2.0454	2.0476	2.3400	1.6475	2.8925	1.1575
7Y	2.1800	0.00	2.1475	2.0849	2.0888	2.3950	1.7050	2.9950	1.1675
10Y	2.2475	0.00	2.2145	2.1524	2.1531	2.4850	1.7825	3.1250	1.2125
12Y	2.2850	0.00	2.2530	2.1920	2.1920	2.5225	1.8175	3.1675	1.2150
15Y	2.2950	0.00	2.2630	2.2038	2.2083	2.5400	1.8250	3.2075	1.2150
20Y	2.2950	0.00	2.2660	2.2100	2.2175	2.5600	1.8250	3.3275	1.2150

6*9M	6.75	0.00	6.30	5.28	5.04	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	4.50	0.00	4.25	3.55	3.46	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	12.25	0.00	11.15	8.53	9.52	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	5.75	0.00	5.20	4.79	5.21	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	10.25	0.00	9.40	8.88	9.51	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	13.50	0.00	12.45	11.86	12.94	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.50	0.00	4.20	4.09	4.30	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.75	0.00	7.25	7.08	7.73	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.05	2.99	3.43	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.75	0.00	3.70	3.95	4.12	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.50	0.00	10.40	10.70	10.55	18.00	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	0.00	6.70	6.75	6.43	10.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.85	3.96	3.89	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.85	5.14	5.51	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	4.75	0.00	5.15	5.76	6.44	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.907	0.00	1.897	1.865	1.836	1.935	1.400	2.625	1.237
1.5Y	2.012	0.00	1.985	1.933	1.919	2.113	1.517	2.660	1.232
2Y	2.052	0.00	2.028	1.969	1.970	2.230	1.577	2.686	1.225
3Y	2.080	0.00	2.051	2.000	2.016	2.315	1.617	2.725	1.200
4Y	2.217	0.00	2.184	2.140	2.133	2.502	1.760	2.850	1.232
5Y	2.265	0.00	2.231	2.182	2.223	2.602	1.830	2.980	1.217
7Y	2.371	0.00	2.339	2.295	2.344	2.728	2.024	3.075	1.270
10Y	2.445	0.00	2.417	2.369	2.427	2.815	2.115	3.315	1.355
20Y	2.420	0.00	2.396	2.333	2.396	2.792	2.176	3.490	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.49	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.12	0.00	108.13	108.15	108.09
LKTB	122.34	0.00	122.10	122.34	122.05

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	-2.20	0.00	-2.23	-2.33	-1.33	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-4.95	0.00	-3.90	-3.89	-3.87	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-4.45	0.00	-4.24	-4.27	-5.20	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-1.50	0.00	-1.30	-2.53	-4.53	-0.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-10.70	0.00	-10.42	-12.45	-11.98	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.25	0.00	-12.03	-13.67	-17.56	-11.65	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-19.10	0.00	-19.19	-21.00	-25.50	-19.10	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-19.75	0.00	-20.25	-21.67	-27.40	-19.75	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-12.50	0.00	-13.00	-12.34	-17.84	-7.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-46.50	0.00
-59.75	0.00
-66.25	0.00
-72.00	0.00
-74.50	0.00
-72.25	0.00
-70.00	0.00
-52.75	0.00

CRS

USD/KRW 1130.40 (0.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.4200	0.00	1.6200	0.8050	1*2Y	-7.50	0.00
1.5Y	1.3650	0.00	1.6600	0.8600	2*3Y	0.00	0.00
2Y	1.3450	0.00	1.6950	0.9250	2*5Y	7.50	0.00
3Y	1.3450	0.00	1.7550	0.9850	3*4Y	2.00	0.00
4Y	1.3650	0.00	1.8000	1.0700	3*5Y	7.50	0.00
5Y	1.4200	0.00	1.8500	1.0800	4*5Y	5.50	0.00
7Y	1.4800	0.00	1.8950	1.1050	5*7Y	6.00	0.00
10Y	1.7200	0.00	2.0500	1.2200	5*10Y	30.00	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	2.8890	0.0040	2.8850	2.8681	2.8679	2.8890	1.2620	2.8890	0.3100
10Y	3.2306	0.0000	3.2306	3.1858	3.1873	3.2306	2.0387	3.2306	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	83.70	0.4	83.30	81.81	87.39	88.61	-53.43	88.61	-223.00
10Y	78.56	0.00	78.56	74.08	81.23	81.23	-24.46	81.23	-76.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	24.00	0.00	24.00	24.25	21.00	42.50	19.25	62.75	2.75
KTB 2*10Y	39.30	0.00	39.30	39.50	38.10	66.00	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	34.16	-0.40	34.56	31.77	31.94	98.63	18.51	218.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	77	ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	02 / 2.25	SPRD	
03Y	8		
04Y	12.5 / 12.75		
05Y	16.25		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y	31.25		
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	55 건	0	55	164	0	126	97	155
금 액	16,460 억원	0	16,460	66,408	0,000	35,740	29,240	53,962

장중동향

채권은 연내 기준금리인상에 무게를 두고 단기물을 중심으로 금리상승. 반면 장기물은 강세. 국채선물은 약세출발해 저가매수가 유입되며 보합마감.

IRS는 비구가 우위를 보이며 1년을 제외한 전구간 상승.

CRS도 전구간 상승마감.