IPS Daily Morning Brief

2018-10-12

종가 기준일 2018-10-11

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7600	-0.75	1.7685	1.7581	1.7407	1.7725	1.3900	2.6275	1.2875
9M	1.8175	-1.25	1.8330	1.8155	1.7911	1.8400	1.4100	2.6225	1.2500
1Y	1.8575	-1.50	1.8765	1.8545	1.8256	1.9100	1.4350	2.6175	1.2200
1.5Y	1.9175	-3.25	1.9520	1.9128	1.8823	2.0250	1.4700	2.6450	1.1900
2Y	1.9625	-3.75	1.9990	1.9503	1.9203	2.1150	1.5000	2.6700	1.1675
3Y	2.0100	-4.25	2.0540	2.0005	1.9716	2.2225	1.5550	2.7350	1.1550
4Y	2.0550	-4.50	2.1000	2.0430	2.0147	2.2950	1.6050	2.8050	1.1575
5Y	2.0900	-4.25	2.1340	2.0736	2.0490	2.3400	1.6475	2.8600	1.1575
7Y	2.1250	-4.25	2.1700	2.1125	2.0903	2.3950	1.7050	2.9600	1.1675
10Y	2.1900	-4.50	2.2375	2.1804	2.1548	2.4850	1.7825	3.0850	1.2125
12Y	2.2250	-4.75	2.2745	2.2195	2.1935	2.5225	1.8175	3.1275	1.2150
15Y	2.2300	-5.00	2.2830	2.2305	2.2088	2.5400	1.8250	3.1650	1.2150
20Y	2.2300	-5.00	2.2830	2.2354	2.2172	2.5600	1.8250	3.2850	1.2150

6*9M	5.75	-0.50	6.45	5.74	5.04	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	4.00	-0.25	4.35	3.90	3.45	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	10.50	-2.25	12.25	9.58	9.47	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	4.75	-0.50	5.50	5.03	5.13	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	9.25	-0.75	10.10	9.28	9.44	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	12.75	-0.50	13.50	12.34	12.87	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.50	-0.25	4.60	4.25	4.31	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.00	0.00	8.00	7.31	7.74	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.25	3.40	3.06	3.43	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.50	0.00	3.60	3.89	4.13	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	-0.25	10.35	10.68	10.58	17.75	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	-0.25	6.75	6.79	6.45	10.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.50	-0.25	3.70	3.91	3.87	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	-0.50	4.55	5.01	5.40	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	-0.50	4.55	5.50	6.24	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.876	-1.50	1.898	1.880	1.839	1.935	1.400	2.625	1.237
1.5Y	1.975	-1.70	2.001	1.954	1.921	2.113	1.517	2.658	1.232
2Y	1.994	-3.10	2.036	1.992	1.970	2.230	1.577	2.685	1.225
3Y	2.020	-3.50	2.064	2.021	2.014	2.315	1.617	2.710	1.200
4Y	2.147	-4.30	2.200	2.163	2.132	2.502	1.760	2.805	1.232
5Y	2.200	-4.00	2.250	2.207	2.219	2.602	1.830	2.927	1.217
7Y	2.298	-4.30	2.352	2.317	2.338	2.728	2.024	3.022	1.270
10Y	2.365	-4.50	2.421	2.391	2.420	2.815	2.115	3.250	1.355
20Y	2.300	-4.70	2.376	2.357	2.386	2.792	2.176	3.420	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.48	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.35	0.15	108.28	108.39	108.26
LKTB	123.15	0.49	123.00	123.26	122.88

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	-1.85	0.00	-2.17	-2.59	-1.37	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-5.75	-1.55	-4.86	-4.16	-3.90	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-3.15	-0.65	-3.66	-4.14	-5.00	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-1.00	-0.75	-1.00	-2.09	-4.23	-0.25	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-9.20	-0.20	-9.96	-11.96	-11.73	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-11.00	-0.25	-11.64	-13.30	-16.99	-10.75	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.30	0.05	-18.16	-20.42	-24.78	-17.30	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-17.50	0.00	-18.39	-21.05	-26.57	-17.45	-38.45	-8.20	-38.70
20Y	-7.00	-0.30	-9.32	-12.17	-16.91	-6.70	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-45.75	-4.00
-57.75	-2.25
-65.25	-2.75
-69.50	-2.25
-71.50	-1.50
-69.50	-1.75
-66.00	-2.75
-49.00	-3.50

CRS

USD/KRW 1144.40 (+10.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.4000	-5.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-9.00	-1.00
1.5Y	1.3400	-5.50	1.6600	0.8600	2*3Y	0.50	0.00
2Y	1.3100	-6.50	1.6950	0.9250	2*5Y	8.50	0.50
3Y	1.3150	-6.50	1.7550	0.9850	3*4Y	2.50	0.50
4Y	1.3400	-6.00	1.8000	1.0700	3*5Y	8.00	0.50
5Y	1.3950	-6.00	1.8500	1.0800	4*5Y	5.50	0.00
7Y	1.4650	-7.00	1.8950	1.1050	5*7Y	7.00	-1.00
10Y	1.7000	-8.00	2.0500	1.2200	5*10Y	30.50	-2.00

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	2.8608	0.0125	2.8483	2.8852	2.8890	2.8890	1.2620	2.8890	0.3100
10Y	3.1513	-0.0170	3.1683	3.2079	3.2306	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	86.68	4.35	82.33	83.02	83.70	88.61	-53.43	88.61	-223.00
10Y	78.63	2.80	75.83	76.59	78.56	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	22.75	-0.75	23.50	25.00	24.00	42.50	19.25	62.75	2.75
KTB 2*10Y	37.10	-1.40	38.50	38.70	39.30	64.80	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	29.05	-2.95	32.00	32.27	34.16	98.63	18.51	218.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6y 11
06M	76 / 76.5		
09M			
01Y	85.5 / 85.75 / 86		
1.5Y	91.5 / 91.75 / 93 / 93.25		
02Y	96 / 96.25 / 97 / 97.25 / 97.5	SPRD	6*24m 20.25
03Y	01 / 1.75 / 02		9*12m 04
04Y	5.25 / 7.5		1.5*3y 9.25
05Y	09 / 10 / 10.5		2*3y 05
07Y			2*10y 22.5 / 22.75
10Y	19.25 / 20.5		3*4y 4.5
12Y			10*20y 04
15Y			
20Y			10*12*15y fly 03
CRS	1y 40 / 2y 32 33 35 / 3y 31.5		

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	154 건	49	105	0	88	55	164	0
금 액	63,789 억원	24,672	39,117	0,000	29,415	16,460	66,408	0,000

장중동향

채권은 미국주식의 하락으로 강세출발, 국내증시 하락으로 강세를 유지하며 금리하락 마감.

IRS는 미국과 국내주식의 폭락으로 안전자산 선호현상이 커지며 오퍼리시해져 레벨 하락. 커브 플랫마감.

CRS도 환율 급등의 영향으로 하락마감.