IPS Daily Morning Brief

2018-10-15

종가 기준일 2018-10-12

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7925	3.25	1.7725	1.7606	1.7420	1.7925	1.3900	2.6225	1.2875
9M	1.8500	3.25	1.8350	1.8185	1.7925	1.8500	1.4100	2.6150	1.2500
1Y	1.8900	3.25	1.8775	1.8581	1.8269	1.9100	1.4350	2.6075	1.2200
1.5Y	1.9500	3.25	1.9495	1.9178	1.8833	2.0250	1.4700	2.6325	1.1900
2Y	1.9900	2.75	1.9955	1.9559	1.9210	2.1150	1.5000	2.6575	1.1675
3Y	2.0375	2.75	2.0485	2.0066	1.9721	2.2225	1.5550	2.7200	1.1550
4Y	2.0825	2.75	2.0945	2.0496	2.0153	2.2950	1.6050	2.7900	1.1575
5Y	2.1175	2.75	2.1290	2.0806	2.0495	2.3400	1.6475	2.8450	1.1575
7Y	2.1525	2.75	2.1645	2.1191	2.0907	2.3950	1.7050	2.9375	1.1675
10Y	2.2175	2.75	2.2315	2.1870	2.1553	2.4850	1.7825	3.0600	1.2125
12Y	2.2525	2.75	2.2680	2.2259	2.1939	2.5225	1.8175	3.1025	1.2150
15Y	2.2575	2.75	2.2755	2.2365	2.2089	2.5400	1.8250	3.1400	1.2150
20Y	2.2575	2.75	2.2755	2.2410	2.2170	2.5600	1.8250	3.2600	1.2150

6*9M	5.75	0.00	6.25	5.79	5.05	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	4.00	0.00	4.25	3.96	3.44	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	10.00	-0.50	11.80	9.78	9.41	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	4.75	0.00	5.30	5.08	5.11	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	9.25	0.00	9.90	9.38	9.42	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	12.75	0.00	13.35	12.48	12.84	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.50	0.00	4.60	4.30	4.31	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.00	0.00	8.05	7.40	7.73	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.45	3.10	3.42	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.50	0.00	3.55	3.85	4.13	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	0.00	10.25	10.64	10.58	17.75	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.70	6.79	6.45	10.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.00	3.65	3.89	3.86	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.40	4.95	5.36	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	0.00	4.40	5.40	6.18	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.890	1.40	1.895	1.883	1.840	1.935	1.400	2.625	1.237
1.5Y	1.990	1.50	1.996	1.960	1.922	2.113	1.517	2.658	1.232
2Y	2.015	2.10	2.028	1.997	1.970	2.230	1.577	2.685	1.225
3Y	2.050	3.00	2.058	2.026	2.013	2.315	1.617	2.710	1.200
4Y	2.173	2.60	2.191	2.167	2.132	2.502	1.760	2.805	1.232
5Y	2.230	3.00	2.243	2.212	2.218	2.602	1.830	2.910	1.217
7Y	2.330	3.20	2.343	2.321	2.336	2.728	2.024	3.000	1.270
10Y	2.400	3.50	2.412	2.395	2.418	2.815	2.115	3.240	1.355
20Y	2.320	2.00	2.356	2.361	2.383	2.792	2.176	3.391	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.66	1.00
CALL	1.51	3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.27	-0.08	108.33	108.34	108.23
LKTB	122.80	-0.35	123.05	123.42	122.74

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	0.00	1.85	-1.73	-2.52	-1.35	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-4.00	1.75	-4.67	-4.18	-3.90	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-2.50	0.65	-3.27	-4.08	-4.94	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-1.25	-0.25	-0.95	-1.94	-4.13	-0.25	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-9.05	0.15	-9.63	-11.73	-11.64	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-11.25	-0.25	-11.44	-13.14	-16.81	-10.75	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.75	-0.45	-17.89	-20.21	-24.56	-17.30	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-18.25	-0.75	-18.09	-20.84	-26.31	-17.45	-38.25	-8.20	-38.70
20Y	-6.25	0.75	-8.07	-12.03	-16.58	-6.25	-47.25	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-50.50	-4.75
-62.50	-4.75
-69.00	-3.75
-73.75	-4.25
-75.25	-3.75
-72.75	-3.25
-69.25	-3.25
-52.75	-3.75

CRS

USD/KRW 1131.40 (-13.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3850	-1.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-8.50	0.50
1.5Y	1.3250	-1.50	1.6600	0.8600	2*3Y	0.00	-0.50
2Y	1.3000	-1.00	1.6950	0.9250	2*5Y	9.00	0.50
3Y	1.3000	-1.50	1.7550	0.9850	3*4Y	3.00	0.50
4Y	1.3300	-1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	9.00	1.00
5Y	1.3900	-0.50	1.8500	1.0800	4*5Y	6.00	0.50
7Y	1.4600	-0.50	1.8950	1.1050	5*7Y	7.00	0.00
10Y	1.6900	-1.00	2.0500	1.2200	5*10Y	30.00	-0.50

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	2.8612	0.0004	2.8608	2.8483	2.8852	2.8890	1.2620	2.8890	0.3100
10Y	3.1562	0.0049	3.1513	3.1683	3.2079	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	84.62	-2.06	86.68	82.33	83.02	88.61	-53.43	88.61	-222.00
10Y	75.62	-3.01	78.63	75.83	76.59	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	0.00	22.75	23.50	25.00	42.50	19.25	62.75	2.75
KTB 2*10Y	38.50	1.40	37.10	38.50	38.70	64.80	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	29.50	0.45	29.05	32.00	32.27	98.63	18.51	218.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	
06M	77.5		
09M			
01Y			
1.5Y	94.25		
02Y	97.5 / 99 / 97 / 98	SPRD	1*2Y 10
03Y	03 / 3.25		2*7Y 16.5
04Y			5*7Y 3.5
05Y			
07Y	15		
10Y	20.75 / 22		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	136 건	-18	154	105	0	88	55	164
금 액	52,555 억원	-11,234	63,789	39,117	0,000	29,415	16,460	66,408

장중동향

국고채 금리, 국내 증시가 강세로 전환하면서 전일 안전자산 선호로 인한 금리 하락세 되돌리며 금리 상승 마감.

IRS, 전구간 금리 상승.
아시아장에서 미 주가지수 선물이 오르자 미국 금리가 상승한 데 영향.

CRS, 금리 전반 하락. 그동안 급등에 따른 피로감. 에셋 물량 지속.