

IPS Daily Morning Brief

2018-10-16

종가 기준일 2018-10-15

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7925	0.00	1.7765	1.7630	1.7433	1.7925	1.3900	2.6225	1.2875
9M	1.8475	-0.25	1.8365	1.8213	1.7938	1.8500	1.4100	2.6150	1.2500
1Y	1.8900	0.00	1.8785	1.8615	1.8282	1.9100	1.4350	2.6075	1.2200
1.5Y	1.9475	-0.25	1.9465	1.9224	1.8842	2.0250	1.4700	2.6325	1.1900
2Y	1.9850	-0.50	1.9910	1.9610	1.9216	2.1150	1.5000	2.6575	1.1675
3Y	2.0325	-0.50	2.0420	2.0121	1.9724	2.2225	1.5550	2.7200	1.1550
4Y	2.0725	-1.00	2.0870	2.0554	2.0155	2.2950	1.6050	2.7900	1.1575
5Y	2.1050	-1.25	2.1215	2.0866	2.0495	2.3400	1.6475	2.8450	1.1575
7Y	2.1375	-1.50	2.1560	2.1245	2.0907	2.3950	1.7050	2.9375	1.1675
10Y	2.2000	-1.75	2.2220	2.1923	2.1552	2.4850	1.7825	3.0600	1.2125
12Y	2.2325	-2.00	2.2575	2.2308	2.1937	2.5225	1.8175	3.1025	1.2150
15Y	2.2375	-2.00	2.2640	2.2410	2.2084	2.5400	1.8250	3.1400	1.2150
20Y	2.2375	-2.00	2.2640	2.2451	2.2163	2.5600	1.8250	3.2600	1.2150

6*9M	5.50	-0.25	6.00	5.83	5.05	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	4.25	0.25	4.20	4.03	3.44	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	9.50	-0.50	11.25	9.95	9.35	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	4.75	0.00	5.10	5.11	5.08	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	8.75	-0.50	9.60	9.44	9.38	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	12.00	-0.75	13.05	12.56	12.79	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.00	-0.50	4.50	4.33	4.30	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.25	-0.75	7.95	7.45	7.71	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	-0.25	3.45	3.12	3.41	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.25	-0.25	3.45	3.79	4.11	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.50	-0.50	10.05	10.56	10.57	17.75	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	-0.25	6.60	6.78	6.45	10.25	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.25	-0.25	3.55	3.85	3.85	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	-0.25	4.20	4.87	5.32	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	-0.25	4.20	5.29	6.10	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.900	1.00	1.893	1.886	1.842	1.935	1.400	2.625	1.237
1.5Y	1.990	0.00	1.992	1.964	1.923	2.113	1.517	2.658	1.232
2Y	2.017	0.20	2.021	2.001	1.971	2.230	1.577	2.685	1.225
3Y	2.050	0.00	2.052	2.030	2.013	2.315	1.617	2.710	1.200
4Y	2.166	-0.70	2.181	2.170	2.131	2.502	1.760	2.805	1.232
5Y	2.225	-0.50	2.235	2.216	2.216	2.602	1.830	2.910	1.217
7Y	2.317	-1.30	2.333	2.324	2.334	2.728	2.024	3.000	1.270
10Y	2.380	-2.00	2.399	2.398	2.416	2.815	2.115	3.240	1.355
20Y	2.307	-1.30	2.334	2.363	2.379	2.792	2.176	3.391	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.66	0.00
CALL	1.51	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.28	0.01	108.28	108.34	108.26
LKTb	123.01	0.21	122.89	123.09	122.83

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-1.00	-1.00	-1.49	-2.47	-1.36	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-4.25	-0.25	-4.53	-4.18	-3.91	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-3.20	-0.70	-3.02	-4.00	-4.89	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-1.75	-0.50	-1.00	-1.79	-4.06	-0.25	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-9.35	-0.30	-9.36	-11.46	-11.57	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.00	-0.75	-11.39	-12.96	-16.65	-10.75	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.95	-0.20	-17.66	-19.98	-24.34	-17.30	-35.15	-3.75	-37.65
10Y	-18.00	0.25	-17.74	-20.59	-26.05	-17.45	-38.15	-8.20	-38.70
20Y	-6.95	-0.70	-6.96	-11.77	-16.26	-6.25	-45.35	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1134.30 (+2.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-49.50	1.00	1Y	1.3950	1.00	1.6200	0.8050	1*2Y	-10.00	-1.50		
-62.25	0.25	1.5Y	1.3250	0.00	1.6600	0.8600	2*3Y	0.50	0.50		
-69.00	0.00	2Y	1.2950	-0.50	1.6950	0.9250	2*5Y	9.50	0.50		
-73.25	0.50	3Y	1.3000	0.00	1.7550	0.9850	3*4Y	3.00	0.00		
-74.25	1.00	4Y	1.3300	0.00	1.8000	1.0700	3*5Y	9.00	0.00		
-71.50	1.25	5Y	1.3900	0.00	1.8500	1.0800	4*5Y	6.00	0.00		
-68.25	1.00	7Y	1.4550	-0.50	1.8950	1.1050	5*7Y	6.50	-0.50		
-51.50	1.25	10Y	1.6850	-0.50	2.0500	1.2200	5*10Y	29.50	-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	2.8572	-0.0040	2.8612	2.8608	2.8483	2.8890	1.2620	2.8890	0.3100
10Y	3.1572	0.0010	3.1562	3.1513	3.1683	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	84.02	-0.6	84.62	86.68	82.33	88.61	-53.43	88.61	-222.00
10Y	77.72	2.10	75.62	78.63	75.83	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	21.50	-1.25	22.75	22.75	23.50	42.50	19.25	62.75	2.75
KTb 2*10Y	36.30	-2.20	38.50	37.10	38.50	64.30	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	30.00	0.50	29.50	29.05	32.00	98.63	18.51	217.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6y 12.25						
06M	79.25								
09M	84.75								
01Y	88.75 / 89								
1.5Y	94.5								
02Y	98 / 98.25								
03Y	2.75 / 03								
04Y	7	SPRD	6*9m 5.5						
05Y	10.5		6*12m 9.5						
07Y	13.5		9*12m 04						
10Y			1.5*3y 8.5						
12Y			2*4y 8.75						
15Y			4*10y 12.75						
20Y			10*15y 3.75						
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	75 건	-61	136	154	105	0	88	55	
금 액	31,648 억원	-20,907	52,555	63,789	39,117	0,000	29,415	16,460	

장중동향
 채권금리 단기약세 장기강세로 혼조 마감.
 강세 출발한 채권은 금투위 경계로 단기가 강세폭을 반납했고, 경기 불확실성 우려로 장기는 강세를 유지.

IRS도 6개월, 1년이 보합에 머무른것을 제외하고는 채권에 연동해 레벨이 하락하며 커브 플랫마감. 오전에는 거래가 뜸하다가 오후에 거래가 이뤄져.

CRS는 보험권에서 마감.