

IPS Daily Morning Brief

2018-10-17

종가 기준일 2018-10-16

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7925	0.00	1.7810	1.7654	1.7443	1.7925	1.3900	2.6225	1.2875
9M	1.8475	0.00	1.8385	1.8239	1.7949	1.8500	1.4100	2.6150	1.2500
1Y	1.8950	0.50	1.8810	1.8650	1.8293	1.9100	1.4350	2.6075	1.2200
1.5Y	1.9475	0.00	1.9425	1.9265	1.8848	2.0250	1.4700	2.6325	1.1900
2Y	1.9875	0.25	1.9850	1.9659	1.9220	2.1150	1.5000	2.6575	1.1675
3Y	2.0300	-0.25	2.0325	2.0170	1.9724	2.2225	1.5550	2.7200	1.1550
4Y	2.0700	-0.25	2.0760	2.0603	2.0153	2.2950	1.6050	2.7875	1.1575
5Y	2.1025	-0.25	2.1095	2.0918	2.0491	2.3400	1.6475	2.8400	1.1575
7Y	2.1350	-0.25	2.1435	2.1289	2.0901	2.3950	1.7050	2.9300	1.1675
10Y	2.1950	-0.50	2.2075	2.1960	2.1546	2.4850	1.7825	3.0475	1.2125
12Y	2.2275	-0.50	2.2420	2.2341	2.1930	2.5225	1.8175	3.0900	1.2150
15Y	2.2325	-0.50	2.2475	2.2440	2.2073	2.5400	1.8250	3.1300	1.2150
20Y	2.2325	-0.50	2.2475	2.2478	2.2149	2.5600	1.8250	3.2500	1.2150

6*9M	5.50	0.00	5.75	5.85	5.06	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	4.75	0.50	4.25	4.11	3.44	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	9.25	-0.25	10.40	10.09	9.28	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	4.25	-0.50	4.75	5.11	5.03	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	8.25	-0.50	9.10	9.44	9.32	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	11.50	-0.50	12.45	12.59	12.71	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.00	0.00	4.35	4.33	4.29	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.25	0.00	7.70	7.48	7.68	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.35	3.15	3.39	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.25	0.00	3.40	3.71	4.10	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.25	-0.25	9.80	10.43	10.55	17.75	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.00	-0.25	6.40	6.71	6.45	10.25	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.45	3.81	3.84	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	0.00	4.00	4.80	5.27	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	0.00	4.00	5.18	6.03	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.910	1.00	1.893	1.890	1.843	1.935	1.400	2.625	1.237
1.5Y	1.990	0.00	1.987	1.969	1.924	2.113	1.517	2.658	1.232
2Y	2.020	0.30	2.014	2.005	1.970	2.230	1.577	2.685	1.225
3Y	2.041	-0.90	2.043	2.033	2.012	2.315	1.617	2.710	1.200
4Y	2.155	-1.10	2.166	2.172	2.130	2.502	1.760	2.805	1.232
5Y	2.210	-1.50	2.221	2.219	2.214	2.602	1.830	2.910	1.217
7Y	2.308	-0.90	2.319	2.327	2.331	2.728	2.024	2.996	1.270
10Y	2.375	-0.50	2.386	2.400	2.412	2.815	2.115	3.217	1.355
20Y	2.297	-1.00	2.314	2.364	2.374	2.792	2.176	3.365	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.68	1.00
CALL	1.48	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.34	0.06	108.26	108.34	108.25
LKTb	123.07	0.06	122.95	123.11	122.86

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-1.50	-0.50	-1.24	-2.45	-1.38	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-4.25	0.00	-4.49	-4.23	-3.94	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-3.25	-0.05	-2.92	-3.95	-4.84	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-1.10	0.65	-1.07	-1.65	-3.99	-0.25	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-8.50	0.85	-9.02	-11.21	-11.49	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.75	1.25	-11.15	-12.77	-16.47	-10.75	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.30	0.65	-17.53	-19.77	-24.13	-17.30	-35.15	-3.75	-37.65
10Y	-18.00	0.00	-17.85	-20.41	-25.79	-17.45	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-6.45	0.50	-6.67	-11.58	-15.96	-6.25	-44.70	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1128.00 (-6.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-50.00	-0.50	1Y	1.3950	0.00	1.6200	0.8050	1*2Y	-10.50	-0.50	
-62.75	-0.50	1.5Y	1.3200	-0.50	1.6600	0.8600	2*3Y	0.00	-0.50	
-69.75	-0.75	2Y	1.2900	-0.50	1.6950	0.9250	2*5Y	8.50	-1.00	
-74.00	-0.75	3Y	1.2900	-1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	2.50	-0.50	
-75.50	-1.25	4Y	1.3150	-1.50	1.8000	1.0700	3*5Y	8.50	-0.50	
-72.75	-1.25	5Y	1.3750	-1.50	1.8500	1.0800	4*5Y	6.00	0.00	
-69.50	-1.25	7Y	1.4400	-1.50	1.8950	1.1050	5*7Y	6.50	0.00	
-53.50	-2.00	10Y	1.6600	-2.50	2.0500	1.2200	5*10Y	28.50	-1.00	

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	2.8697	0.0125	2.8572	2.8612	2.8608	2.8890	1.2620	2.8890	0.3100
10Y	3.1658	0.0086	3.1572	3.1562	3.1513	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	84.97	0.95	84.02	84.62	86.68	88.61	-53.43	88.61	-222.00
10Y	79.08	1.36	77.72	75.62	78.63	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	20.75	-0.75	21.50	22.75	22.75	42.50	19.25	62.75	2.75
KTb 2*10Y	35.50	-0.80	36.30	38.50	37.10	64.30	35.50	82.90	11.80
UST 2*10Y	29.61	-0.39	30.00	29.50	29.05	98.63	18.51	217.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	89.5 / 89.75								
1.5Y									
02Y	99	SPRD	1*2y	9.25					
03Y			1.5*3y	8.5					
04Y	8		3*4y	04					
05Y	10.5 / 11 / 11.25		4*5y	3.25					
07Y									
10Y	20.5								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	108 건	33	75	136	154	105	0	88	
금 액	39,551 억원	7,903	31,648	52,555	63,789	39,117	0,000	29,415	

장중동향
 금통위를 앞두고 경계감.
 등락을 거듭하던 채권은 보험권으로 돌아왔고 외국인의 매수로 강보합 마감.

IRS는 최근 CD가 상승한것을 반영해 단기 비드가 꾸준한 모습을 보이며 커브 플랫 마감.

CRS는 1년을 제외한 전구간 하락 마감.