

IPS Daily Morning Brief

2018-10-19

종가 기준일 2018-10-18

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7875	-0.25	1.7910	1.7690	1.7464	1.7925	1.3900	2.6225	1.2875
9M	1.8200	-2.00	1.8410	1.8263	1.7966	1.8500	1.4100	2.6150	1.2500
1Y	1.8575	-2.25	1.8825	1.8675	1.8308	1.9100	1.4350	2.6075	1.2200
1.5Y	1.8975	-2.25	1.9325	1.9276	1.8850	2.0250	1.4700	2.6325	1.1900
2Y	1.9325	-2.00	1.9695	1.9668	1.9216	2.1150	1.5000	2.6575	1.1675
3Y	1.9650	-2.75	2.0115	2.0159	1.9709	2.2225	1.5550	2.7175	1.1550
4Y	2.0000	-3.00	2.0510	2.0583	2.0133	2.2950	1.6050	2.7800	1.1575
5Y	2.0325	-3.00	2.0840	2.0899	2.0468	2.3400	1.6475	2.8350	1.1575
7Y	2.0675	-2.75	2.1175	2.1258	2.0876	2.3950	1.7050	2.9200	1.1675
10Y	2.1300	-2.50	2.1795	2.1916	2.1521	2.4850	1.7825	3.0325	1.2125
12Y	2.1625	-2.50	2.2125	2.2290	2.1902	2.5225	1.8175	3.0750	1.2150
15Y	2.1650	-2.75	2.2170	2.2380	2.2038	2.5400	1.8250	3.1175	1.2150
20Y	2.1650	-2.75	2.2170	2.2410	2.2110	2.5600	1.8250	3.2375	1.2150

6*9M	3.25	-1.75	5.00	5.73	5.02	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	3.75	-0.25	4.15	4.13	3.42	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	7.50	0.25	8.70	9.93	9.08	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	3.25	-0.75	4.20	4.91	4.93	13.25	3.25	13.25	-1.75
2*4Y	6.75	-1.00	8.15	9.15	9.17	21.75	6.75	23.50	-1.75
2*5Y	10.00	-1.00	11.45	12.31	12.53	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	3.50	-0.25	3.95	4.24	4.24	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	6.75	-0.25	7.25	7.40	7.60	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.30	3.16	3.35	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.50	0.25	3.35	3.59	4.08	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.75	0.50	9.55	10.18	10.53	17.50	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.25	6.20	6.59	6.45	10.25	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.30	3.74	3.81	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	-0.25	3.75	4.64	5.18	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	-0.25	3.75	4.94	5.89	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.875	-3.50	1.897	1.892	1.845	1.935	1.400	2.625	1.237
1.5Y	1.941	-3.10	1.977	1.971	1.925	2.113	1.517	2.658	1.232
2Y	1.970	-3.00	2.004	2.006	1.970	2.230	1.577	2.685	1.225
3Y	1.977	-3.50	2.026	2.031	2.010	2.315	1.617	2.710	1.200
4Y	2.084	-3.60	2.140	2.165	2.127	2.502	1.760	2.805	1.232
5Y	2.127	-4.00	2.192	2.213	2.208	2.602	1.830	2.910	1.217
7Y	2.228	-3.60	2.289	2.318	2.324	2.728	2.024	2.996	1.270
10Y	2.297	-3.30	2.356	2.391	2.405	2.815	2.115	3.205	1.355
20Y	2.225	-2.50	2.280	2.349	2.364	2.792	2.176	3.356	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.69	1.00
CALL	1.50	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.57	0.10	108.43	108.57	108.38
LKTB	123.85	0.33	123.40	123.95	123.27

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	-1.75	1.25	-1.45	-2.44	-1.44	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-4.35	0.85	-4.41	-4.30	-4.01	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-3.75	1.00	-3.49	-3.91	-4.80	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-1.20	0.75	-1.45	-1.53	-3.88	-0.25	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-8.40	0.60	-8.86	-10.68	-11.37	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.45	1.00	-10.78	-12.30	-16.12	-9.45	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-16.05	0.85	-17.19	-19.26	-23.69	-16.05	-35.15	-3.75	-37.65
10Y	-16.70	0.80	-17.69	-19.96	-25.26	-16.70	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-6.00	-0.25	-6.28	-10.85	-15.34	-5.75	-44.45	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1135.20 (+8.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-48.75	1.75	1Y	1.3700	-0.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-12.50	-1.50	
-60.75	1.25	1.5Y	1.2900	-1.00	1.6600	0.8600	2*3Y	-2.00	-1.00	
-68.75	0.00	2Y	1.2450	-2.00	1.6950	0.9250	2*5Y	4.00	-3.50	
-74.00	-0.25	3Y	1.2250	-3.00	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	-1.50	
-76.50	-1.50	4Y	1.2350	-4.50	1.8000	1.0700	3*5Y	6.00	-2.50	
-74.75	-2.50	5Y	1.2850	-5.50	1.8500	1.0800	4*5Y	5.00	-1.00	
-71.75	-2.75	7Y	1.3500	-5.50	1.8950	1.1050	5*7Y	6.50	0.00	
-59.00	-4.50	10Y	1.5400	-7.00	2.0500	1.2200	5*10Y	25.50	-1.50	

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	2.8783	-0.0082	2.8865	2.8697	2.8572	2.8890	1.2620	2.8890	0.3100
10Y	3.1811	-0.0217	3.2028	3.1658	3.1572	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	90.83	2.18	88.65	84.97	84.02	90.83	-53.43	90.83	-220.70
10Y	88.41	1.13	87.28	79.08	77.72	88.41	-24.46	88.41	-76.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	19.75	-0.50	20.25	20.75	21.50	42.50	19.25	62.75	2.75
KTb 2*10Y	32.70	-0.30	33.00	35.50	36.30	63.50	32.70	82.90	11.80
UST 2*10Y	30.28	-1.35	31.63	29.61	30.00	98.63	18.51	215.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M	84								
09M	88.5								
01Y	87.25								
1.5Y									
02Y	95.25 / 93 / 94.5	SPRD							
03Y	98.25								
04Y									
05Y	05 / 6.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y CCS 36								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	110 건	-31	141	108	75	136	154	105	
금 액	31,650 억원	-20,590	52,240	39,551	31,648	52,555	63,789	39,117	

장중동향
 국고채 금리, 한은 금리 1.50% 동결 영향으로 금리 하락 마감.
 시장 참가자들은 전반적으로 11월 금리 인상 가능성이 커졌다고 평가.

IRS, 기준금리 동결에 금리 전 구간 하락.
 장 초반 일부 비드와 함께 금리가 상승했지만, 기준금리 동결과 동시에 오퍼 일색. 금리 하락.
 비드 기반시키며 거래.

CRS도 금리 하락 마감.