IPS Daily Morning Brief

2018-10-22

종가 기준일 2018-10-19

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7925	0.50	1.7910	1.7711	1.7470	1.7925	1.3900	2.6175	1.2875
9M	1.8300	1.00	1.8370	1.8275	1.7969	1.8500	1.4100	2.6075	1.2500
1Y	1.8675	1.00	1.8780	1.8686	1.8309	1.9100	1.4350	2.6000	1.2200
1.5Y	1.9100	1.25	1.9245	1.9283	1.8845	2.0250	1.4700	2.6200	1.1900
2Y	1.9475	1.50	1.9610	1.9674	1.9208	2.1150	1.5000	2.6400	1.1675
3Y	1.9850	2.00	2.0010	2.0156	1.9696	2.2225	1.5550	2.6925	1.1550
4Y	2.0225	2.25	2.0390	2.0575	2.0118	2.2950	1.6050	2.7525	1.1575
5Y	2.0550	2.25	2.0715	2.0891	2.0453	2.3400	1.6475	2.8050	1.1575
7Y	2.0925	2.50	2.1055	2.1248	2.0861	2.3950	1.7050	2.8900	1.1675
10Y	2.1550	2.50	2.1670	2.1903	2.1506	2.4850	1.7825	3.0200	1.2125
12Y	2.1825	2.00	2.1985	2.2270	2.1885	2.5225	1.8175	3.0650	1.2150
15Y	2.1850	2.00	2.2025	2.2355	2.2018	2.5400	1.8250	3.1050	1.2150
20Y	2.1875	2.25	2.2030	2.2383	2.2087	2.5600	1.8250	3.2250	1.2150
6*9M	3.75	0.50	4.60	5.64	4.99	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	3.75	0.00	4.10	4.11	3.40	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	8.00	0.50	8.30	9.88	8.99	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	3.75	0.50	4.00	4.83	4.88	13.25	3.25	13.25	-1.75
2*4Y	7.50	0.75	7.80	9.01	9.11	21.75	6.75	23.50	-1.75
2*5Y	10.75	0.75	11.05	12.18	12.45	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	3.75	0.25	3.80	4.19	4.23	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.00	0.25	7.05	7.35	7.57	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.25	3.16	3.35	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.75	0.25	3.40	3.56	4.08	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	0.25	9.55	10.11	10.53	17.50	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.00	6.15	6.55	6.45	10.25	4.25	16.75	3.00
10*12Y	2.75	-0.50	3.15	3.68	3.79	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	-0.50	3.55	4.53	5.12	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.25	-0.25	3.60	4.80	5.81	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	0.00	1.894	1.892	1.845	1.935	1.400	2.620	1.237
1.5Y	1.933	-0.80	1.965	1.970	1.925	2.113	1.517	2.643	1.232
2Y	1.970	0.00	1.995	2.005	1.968	2.230	1.577	2.667	1.225
3Y	1.982	0.50	2.012	2.030	2.008	2.315	1.617	2.697	1.200
4Y	2.090	0.60	2.123	2.161	2.125	2.502	1.760	2.792	1.232
5Y	2.135	0.80	2.173	2.209	2.204	2.602	1.830	2.892	1.217
7Y	2.244	1.60	2.272	2.314	2.321	2.728	2.024	2.996	1.270
10Y	2.322	2.50	2.341	2.387	2.401	2.815	2.115	3.182	1.355
20Y	2.252	2.70	2.266	2.343	2.359	2.792	2.176	3.340	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	1.00
CALL	1.50	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.55	-0.02	108.57	108.63	108.51
LKTB	123.62	-0.23	123.85	124.07	123.56

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	-0.75	1.00	-1.60	-2.31	-1.46	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-2.30	2.05	-4.07	-4.18	-4.01	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-2.25	1.50	-3.44	-3.78	-4.75	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	0.30	1.50	-1.14	-1.39	-3.80	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-6.75	1.65	-8.40	-10.35	-11.29	-6.75	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-8.00	1.45	-10.13	-11.97	-15.91	-8.00	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-15.15	0.90	-16.67	-18.92	-23.45	-15.15	-35.15	-3.75	-37.65
10Y	-16.70	0.00	-17.38	-19.66	-25.00	-16.70	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-6.45	-0.45	-6.32	-10.46	-15.08	-5.75	-44.45	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-49.25	-0.50
-63.00	-2.25
-72.25	-3.50
-79.50	-5.50
-82.75	-6.25
-81.50	-6.75
-78.75	-7.00
-66.00	-7.00

CRS

USD/KRW 1132.10 (-3.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3750	0.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-15.00	-2.50
1.5Y	1.2800	-1.00	1.6600	0.8600	2*3Y	-3.50	-1.50
2Y	1.2250	-2.00	1.6950	0.9250	2*5Y	1.50	-2.50
3Y	1.1900	-3.50	1.7550	0.9850	3*4Y	0.50	-0.50
4Y	1.1950	-4.00	1.8000	1.0700	3*5Y	5.00	-1.00
5Y	1.2400	-4.50	1.8500	1.0800	4*5Y	4.50	-0.50
7Y	1.3050	-4.50	1.8950	1.1050	5*7Y	6.50	0.00
10Y	1.4950	-4.50	2.0500	1.2200	5*10Y	25.50	0.00

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	2.9122	0.0339	2.8783	2.8865	2.8697	2.9122	1.2620	2.9122	0.3100
10Y	3.1955	0.0144	3.1811	3.2028	3.1658	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	94.22	3.39	90.83	88.65	84.97	94.22	-53.43	94.22	-220.70
10Y	87.35	-1.06	88.41	87.28	79.08	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	20.75	1.00	19.75	20.25	20.75	42.50	19.25	62.75	2.75
KTB 2*10Y	35.20	2.50	32.70	33.00	35.50	63.50	32.70	82.90	11.80
UST 2*10Y	28.33	-1.95	30.28	31.63	29.61	98.63	18.51	215.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	93.75 / 94.5	SPRD	1*3y 11
03Y	96 / 96.25 / 96.5 97 / 97.25		10*20y 0.25
04Y			
05Y	5		
07Y	7.25		
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	102 건	-8	110	141	108	75	136	154
금 액	24,536 억원	-7,114	31,650	52,240	39,551	31,648	52,555	63,789

장중동향

채권은 장기물을 중심으로 금리상승.
미국금리 하락으로 강세를 보리던 채권은 외국인의 매도와 상해증시반등으로 약세.

IRS는 중국증시 상승의 영향으로 레벨 상승하며 스티프닝 마감.

CRS는 1년을 제외한 전 구간에서 학락.