

IPS Daily Morning Brief

2018-10-24

종가 기준일 2018-10-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8025	-0.50	1.7960	1.7766	1.7486	1.8075	1.3900	2.6175	1.2875
9M	1.8400	-0.50	1.8350	1.8313	1.7979	1.8500	1.4100	2.6000	1.2500
1Y	1.8775	-0.50	1.8730	1.8721	1.8314	1.9100	1.4350	2.5925	1.2200
1.5Y	1.9175	-1.00	1.9145	1.9308	1.8838	2.0250	1.4700	2.6050	1.1900
2Y	1.9525	-1.50	1.9505	1.9699	1.9193	2.1150	1.5000	2.6225	1.1675
3Y	1.9925	-1.75	1.9890	2.0168	1.9673	2.2225	1.5550	2.6725	1.1550
4Y	2.0250	-2.25	2.0250	2.0574	2.0092	2.2950	1.6050	2.7325	1.1575
5Y	2.0575	-2.25	2.0575	2.0890	2.0426	2.3400	1.6475	2.7900	1.1575
7Y	2.0950	-2.25	2.0935	2.1241	2.0836	2.3950	1.7050	2.8875	1.1675
10Y	2.1625	-2.25	2.1575	2.1894	2.1484	2.4850	1.7825	3.0200	1.2125
12Y	2.1900	-2.25	2.1870	2.2249	2.1859	2.5225	1.8175	3.0650	1.2150
15Y	2.1900	-2.50	2.1895	2.2323	2.1984	2.5400	1.8250	3.1050	1.2150
20Y	2.1950	-2.25	2.1915	2.2346	2.2049	2.5600	1.8250	3.2250	1.2150

6*9M	3.75	0.00	3.90	5.46	4.93	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	3.75	0.00	3.80	4.09	3.35	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	7.50	-1.00	7.75	9.78	8.79	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	4.00	-0.25	3.85	4.69	4.80	13.25	3.25	13.25	-1.75
2*4Y	7.25	-0.75	7.45	8.75	8.99	21.75	6.75	23.50	-1.75
2*5Y	10.50	-0.75	10.70	11.91	12.33	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	3.25	-0.50	3.60	4.06	4.19	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	6.50	-0.50	6.85	7.23	7.53	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.25	3.16	3.34	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.75	0.00	3.60	3.51	4.10	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.50	0.00	10.00	10.04	10.58	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	0.00	6.40	6.53	6.48	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.95	3.55	3.75	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	2.75	-0.25	3.20	4.29	5.00	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.25	0.00	3.40	4.53	5.65	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.886	0.60	1.885	1.892	1.846	1.935	1.400	2.596	1.237
1.5Y	1.932	-0.80	1.944	1.969	1.923	2.113	1.517	2.615	1.232
2Y	1.982	-1.00	1.983	2.006	1.966	2.230	1.577	2.635	1.225
3Y	1.992	-1.50	1.994	2.028	2.003	2.315	1.617	2.662	1.200
4Y	2.092	-3.00	2.102	2.154	2.120	2.502	1.760	2.767	1.232
5Y	2.137	-3.30	2.147	2.203	2.197	2.602	1.830	2.865	1.217
7Y	2.236	-3.50	2.249	2.306	2.313	2.728	2.024	2.996	1.270
10Y	2.307	-3.50	2.320	2.378	2.392	2.815	2.115	3.167	1.355
20Y	2.255	-3.50	2.254	2.332	2.350	2.792	2.176	3.340	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.53	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.54	0.07	108.48	108.57	108.42
LKTb	123.77	0.32	123.50	123.91	123.34

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	-0.85	-1.10	-1.22	-2.00	-1.43	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-1.45	-0.20	-2.91	-3.83	-3.92	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-2.95	-0.50	-3.23	-3.58	-4.65	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	0.05	-0.25	-0.50	-1.13	-3.60	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-6.70	0.75	-7.66	-9.71	-11.11	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-7.95	1.05	-8.97	-11.37	-15.47	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-14.10	1.25	-15.51	-18.19	-22.94	-14.10	-35.15	-3.75	-37.65
10Y	-14.45	1.25	-16.21	-18.89	-24.40	-14.45	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-6.00	1.25	-6.29	-9.69	-14.53	-5.75	-44.45	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1137.60 (+9.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-51.75	-1.50	1Y	1.3600	-2.00	1.6200	0.8050	1*2Y	-12.00	1.50		
-63.25	0.50	1.5Y	1.2850	-0.50	1.6600	0.8600	2*3Y	-2.50	0.50		
-71.25	1.00	2Y	1.2400	-0.50	1.6950	0.9250	2*5Y	5.50	2.00		
-77.75	1.75	3Y	1.2150	0.00	1.7550	0.9850	3*4Y	1.50	0.00		
-79.50	2.25	4Y	1.2300	0.00	1.8000	1.0700	3*5Y	8.00	1.50		
-76.25	3.75	5Y	1.2950	1.50	1.8500	1.0800	4*5Y	6.50	1.50		
-73.50	3.75	7Y	1.3600	1.50	1.8950	1.1050	5*7Y	6.50	0.00		
-61.25	3.75	10Y	1.5500	1.50	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	2.8883	-0.0241	2.9124	2.9122	2.8783	2.9124	1.2620	2.9124	0.3100
10Y	3.1700	-0.0274	3.1974	3.1955	3.1811	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	90.63	-1.41	92.04	94.22	90.83	94.22	-53.43	94.22	-217.50
10Y	86.30	0.76	85.54	87.35	88.41	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	21.00	-0.75	21.75	20.75	19.75	42.50	19.25	62.75	2.75
KTb 2*10Y	32.50	-2.50	35.00	35.20	32.70	63.50	32.50	82.90	11.80
UST 2*10Y	28.17	-0.33	28.50	28.33	30.28	98.63	18.51	215.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	9y 14						
	06M								
	09M		83.75						
	01Y								
	1.5Y								
	02Y								
	03Y		99 / 99.5						
	04Y		3						
	05Y		5.5 / 6 / 6.25						
	07Y		11.5						
	10Y		16 / 17.5						
	12Y								
15Y									
20Y									
CRS	1y ccs 35.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	84 건	29	55	102	110	141	108	75	
금 액	16,952 억원	912	16,040	24,536	31,650	52,240	39,551	31,648	

장중동향
 채권은 미중 갈등 고조와 주식하락으로 강세 마감.
 안전자산 선호 분위기가 부각된 가운데 아시아지수가 하락하고, 아시아장에서 미국채 금리가 하락한데 따라 금리가 급격히 하락.

IRS는 안전자산 선호로 하락 마감.
 스왑은 대체적으로 비디시한 분위기가 이어졌지만 채권과 마찬가지로 장 후반 급락 마감.

CRS는 환율 상승으로 단기 레벨이 하락하며 커브 스톱 마감.