

IPS Daily Morning Brief

2018-10-29

종가 기준일 2018-10-26

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7825	0.25	1.7945	1.7816	1.7508	1.8075	1.3950	2.6175	1.2875
9M	1.8100	-0.25	1.8290	1.8326	1.7989	1.8500	1.4150	2.6000	1.2500
1Y	1.8275	-1.50	1.8610	1.8719	1.8313	1.9100	1.4375	2.5900	1.2200
1.5Y	1.8625	-1.75	1.9010	1.9284	1.8819	2.0250	1.4775	2.5975	1.1900
2Y	1.8900	-2.00	1.9345	1.9670	1.9159	2.1150	1.5100	2.6125	1.1675
3Y	1.9250	-2.25	1.9735	2.0124	1.9625	2.2225	1.5675	2.6625	1.1550
4Y	1.9550	-2.25	2.0055	2.0515	2.0030	2.2950	1.6175	2.7275	1.1575
5Y	1.9825	-2.75	2.0370	2.0835	2.0358	2.3400	1.6600	2.7875	1.1575
7Y	2.0200	-2.75	2.0745	2.1193	2.0764	2.3950	1.7050	2.8875	1.1675
10Y	2.0825	-3.00	2.1405	2.1843	2.1416	2.4850	1.7825	3.0200	1.2125
12Y	2.1100	-3.00	2.1680	2.2179	2.1785	2.5225	1.8175	3.0650	1.2150
15Y	2.1100	-3.00	2.1685	2.2234	2.1898	2.5400	1.8250	3.1050	1.2150
20Y	2.1175	-3.00	2.1745	2.2260	2.1960	2.5600	1.8250	3.2250	1.2150

6*9M	2.75	-0.50	3.45	5.10	4.81	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	1.75	-1.25	3.20	3.93	3.25	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	6.25	-0.50	7.35	9.51	8.45	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	3.50	-0.25	3.90	4.54	4.66	13.25	3.25	13.25	-1.75
2*4Y	6.50	-0.25	7.10	8.45	8.71	21.75	6.50	23.50	-1.75
2*5Y	9.25	-0.75	10.25	11.65	11.99	27.25	9.25	34.00	-1.75
3*4Y	3.00	0.00	3.20	3.91	4.05	8.50	3.00	11.25	-0.50
3*5Y	5.75	-0.50	6.35	7.11	7.33	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	2.75	-0.50	3.15	3.20	3.28	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.75	0.00	3.75	3.58	4.06	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	-0.25	10.35	10.08	10.58	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	-0.25	6.60	6.50	6.52	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	3.36	3.69	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	2.75	0.00	2.80	3.91	4.83	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	0.00	3.40	4.18	5.44	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.914	0.00	1.899	1.895	1.847	1.935	1.400	2.550	1.237
1.5Y	1.955	-0.10	1.946	1.970	1.921	2.113	1.523	2.575	1.232
2Y	1.985	-0.20	1.987	2.007	1.963	2.230	1.587	2.607	1.225
3Y	1.970	-1.70	1.991	2.025	1.997	2.315	1.630	2.650	1.200
4Y	2.052	-2.00	2.087	2.143	2.113	2.502	1.775	2.767	1.232
5Y	2.080	-2.20	2.125	2.189	2.185	2.602	1.847	2.862	1.217
7Y	2.181	-1.90	2.224	2.291	2.299	2.728	2.024	2.996	1.270
10Y	2.252	-2.00	2.295	2.363	2.377	2.815	2.115	3.158	1.355
20Y	2.202	-1.30	2.242	2.312	2.333	2.792	2.176	3.340	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.52	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.66	0.02	108.63	108.73	108.60
LKTb	124.37	0.17	124.22	124.67	124.22

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	-8.65	-1.50	-3.78	-2.34	-1.58	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-9.25	-1.65	-4.50	-4.15	-3.87	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-9.50	-1.80	-5.27	-4.00	-4.68	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.50	-0.55	-1.77	-1.25	-3.47	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-9.70	-0.25	-8.15	-9.14	-10.97	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.75	-0.55	-8.78	-10.60	-14.88	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-16.10	-0.85	-14.95	-17.21	-22.26	-13.95	-35.15	-4.00	-37.65
10Y	-16.95	-1.00	-15.45	-17.88	-23.57	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-8.45	-1.70	-6.79	-8.61	-13.73	-5.50	-41.95	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1141.90 (+3.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-53.25	-0.50	1Y	1.2950	-2.00	1.6200	0.8200	1*2Y	-10.00	1.00		
-63.25	-0.25	1.5Y	1.2300	-2.00	1.6600	0.8750	2*3Y	-2.50	-1.00		
-69.50	1.00	2Y	1.1950	-1.00	1.6950	0.9450	2*5Y	4.50	-1.50		
-75.50	0.25	3Y	1.1700	-2.00	1.7550	0.9850	3*4Y	0.50	-0.50		
-78.00	-0.25	4Y	1.1750	-2.50	1.8000	1.0700	3*5Y	7.00	-0.50		
-74.25	0.25	5Y	1.2400	-2.50	1.8500	1.1150	4*5Y	6.50	0.00		
-71.50	0.25	7Y	1.3050	-2.50	1.8950	1.1400	5*7Y	6.50	0.00		
-58.75	0.50	10Y	1.4950	-2.50	2.0500	1.2450	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	2.8105	-0.0405	2.8510	2.8431	2.8833	2.9124	1.2620	2.9124	0.3100
10Y	3.0788	-0.0422	3.1210	3.1031	3.1700	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	82.55	-3.85	86.40	85.31	90.13	94.22	-53.43	94.22	-210.20
10Y	82.68	-2.22	84.90	80.11	86.30	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	19.25	-1.00	20.25	20.75	21.00	42.50	19.25	62.75	2.75
KTb 2*10Y	26.70	-1.80	28.50	31.20	32.50	63.50	26.70	82.90	11.80
UST 2*10Y	26.83	-0.17	27.00	26.00	28.67	98.63	18.51	213.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS		ODD Tenor	9Y 06							
06M										
09M										
01Y										
1.5Y	87.5									
02Y	89.75									
03Y	94.5 / 94 / 91.5 / 91		SPRD	2*3Y 04 / 3.75						
04Y	94			3*10Y 15.5						
05Y	00 / 99.75			9*10Y 02						
07Y										
10Y	07 / 08									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6		
거래현황	165 건	16	149	127	84	55	102	110		
금 액	62,515 억원	9,270	53,245	37,035	16,952	16,040	24,536	31,650		

장중동향
국고채 금리 하락 마감.
미국증시 반등에도 국내 증시는 악세를 보이면서 채권은 꾸준한 강세를 보인다 장 후반 강세폭을 조금 되돌리며 마감.

IRS 채권과 연동해 레벨 하락, 커브 플랫트닝.
ELS관련 오퍼물량이 계속되고 주가도 하락하라면 전구간 하락.

CRS도 전구간 하락 마감.