

IPS Daily Morning Brief

2018-10-30

종가 기준일 2018-10-29

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7325	-5.00	1.7795	1.7798	1.7507	1.8075	1.3950	2.6175	1.2875
9M	1.7450	-6.50	1.8090	1.8285	1.7981	1.8500	1.4150	2.6000	1.2500
1Y	1.7575	-7.00	1.8360	1.8664	1.8300	1.9100	1.4375	2.5900	1.2200
1.5Y	1.7800	-8.25	1.8715	1.9211	1.8798	2.0250	1.4775	2.5975	1.1900
2Y	1.8000	-9.00	1.9010	1.9589	1.9132	2.1150	1.5100	2.6125	1.1675
3Y	1.8325	-9.25	1.9380	2.0036	1.9592	2.2225	1.5700	2.6625	1.1550
4Y	1.8625	-9.25	1.9685	2.0424	1.9993	2.2950	1.6175	2.7275	1.1575
5Y	1.8900	-9.25	1.9990	2.0744	2.0317	2.3400	1.6600	2.7875	1.1575
7Y	1.9275	-9.25	2.0365	2.1104	2.0721	2.3950	1.7050	2.8875	1.1675
10Y	1.9900	-9.25	2.1015	2.1755	2.1373	2.4850	1.7825	3.0200	1.2125
12Y	2.0175	-9.25	2.1290	2.2085	2.1740	2.5225	1.8175	3.0650	1.2150
15Y	2.0200	-9.00	2.1295	2.2136	2.1850	2.5400	1.8250	3.1050	1.2150
20Y	2.0275	-9.00	2.1365	2.2164	2.1911	2.5600	1.8250	3.2250	1.2150

6*9M	1.25	-1.50	2.95	4.88	4.74	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	1.25	-0.50	2.70	3.79	3.19	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	4.25	-2.00	6.50	9.25	8.32	23.00	4.25	23.00	-5.50
2*3Y	3.25	-0.25	3.70	4.48	4.60	13.25	3.25	13.25	-1.75
2*4Y	6.25	-0.25	6.75	8.35	8.60	21.75	6.25	23.50	-1.75
2*5Y	9.00	-0.25	9.80	11.55	11.85	27.25	9.00	34.00	-1.75
3*4Y	3.00	0.00	3.05	3.88	4.00	8.50	3.00	11.25	-0.50
3*5Y	5.75	0.00	6.10	7.08	7.25	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	2.75	0.00	3.05	3.20	3.25	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.75	0.00	3.75	3.60	4.04	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	0.00	10.25	10.11	10.55	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.00	6.50	6.51	6.51	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	3.30	3.67	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.25	2.80	3.81	4.78	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	0.25	3.50	4.09	5.38	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.854	-6.00	1.894	1.893	1.847	1.935	1.400	2.550	1.237
1.5Y	1.886	-6.90	1.935	1.967	1.919	2.113	1.523	2.575	1.232
2Y	1.894	-9.10	1.968	2.002	1.961	2.230	1.587	2.607	1.225
3Y	1.882	-8.80	1.966	2.018	1.994	2.315	1.630	2.650	1.200
4Y	1.952	-10.00	2.053	2.133	2.109	2.502	1.775	2.767	1.232
5Y	1.979	-10.10	2.087	2.179	2.179	2.602	1.847	2.862	1.217
7Y	2.085	-9.60	2.187	2.280	2.293	2.728	2.024	2.996	1.270
10Y	2.160	-9.20	2.259	2.352	2.370	2.815	2.115	3.158	1.355
20Y	2.128	-7.40	2.210	2.301	2.326	2.792	2.128	3.340	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.48	-4.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.96	0.30	108.70	108.96	108.63
LKTb	125.30	0.93	124.55	125.30	124.32

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	-9.65	-1.00	-5.76	-2.71	-1.69	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-10.60	-1.35	-6.37	-4.57	-3.94	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-9.40	0.10	-6.66	-4.30	-4.73	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.95	-0.45	-2.82	-1.46	-3.44	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-8.95	0.75	-8.45	-9.06	-10.93	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-8.90	0.85	-8.76	-10.43	-14.69	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-15.75	0.35	-15.03	-17.01	-22.06	-13.95	-35.15	-4.00	-37.65
10Y	-17.00	-0.05	-15.71	-17.66	-23.32	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-10.05	-1.60	-7.35	-8.42	-13.52	-5.50	-40.95	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1141.40 (-0.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-47.25	6.00	1Y	1.2850	-1.00	1.6200	0.8250	1*2Y	-10.50	-0.50		
-56.00	7.25	1.5Y	1.2200	-1.00	1.6600	0.8800	2*3Y	-2.50	0.00		
-62.00	7.50	2Y	1.1800	-1.50	1.6950	0.9450	2*5Y	4.50	0.00		
-67.75	7.75	3Y	1.1550	-1.50	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	0.50		
-69.75	8.25	4Y	1.1650	-1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	7.00	0.00		
-66.50	7.75	5Y	1.2250	-1.50	1.8500	1.1200	4*5Y	6.00	-0.50		
-63.75	7.75	7Y	1.2900	-1.50	1.8950	1.1500	5*7Y	6.50	0.00		
-51.00	7.75	10Y	1.4800	-1.50	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	0.0000	2.8105	2.8510	2.8431	2.9124	1.2620	2.9124	0.3100
10Y	3.0788	0.0000	3.0788	3.1210	3.1031	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	91.65	9.1	82.55	86.40	85.31	94.22	-53.43	94.22	-210.20
10Y	91.88	9.20	82.68	84.90	80.11	91.88	-24.46	91.88	-76.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	19.00	-0.25	19.25	20.25	20.75	42.50	19.00	62.75	2.75
KTb 2*10Y	26.60	-0.10	26.70	28.50	31.20	63.50	26.60	82.90	11.80
UST 2*10Y	26.83	0.00	26.83	27.00	26.00	98.63	18.51	213.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS		ODD Tenor								
06M										
09M	74.5									
01Y	79.25 / 82.5									
1.5Y										
02Y	88.25									
03Y										
04Y										
05Y	94.25		SPRD							
07Y	1.25 / 1.75									
10Y	04 / 4.5									
12Y										
15Y	7									
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP		전일비		T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	134 건	-31	165	149	127	84	55	102		
금 액	40,263 억원	-22,252	62,515	53,245	37,035	16,952	16,040	24,536		

장중동향
 채권 강세 금리 급락. 커브 플랫트닝.
 연이은 주식하락으로 채권이 강세를 보이고 있는가운데 금일은 코스피 2000선이 붕괴되며 강세유지. 이주열 총재가 경기를 비판적으로 전망하며 11월 금리인상이 아닐수도 있다는 발언으로 채권강세에 힘을 실어줌.

IRS는 채권과 마찬가지로 하락. 커브 플랫트닝.

CRS는 전구간 하락 마감.