

IPS Daily Morning Brief

2018-10-31

종가 기준일 2018-10-30

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7575	2.50	1.7705	1.7794	1.7511	1.8075	1.3950	2.6175	1.2875
9M	1.7775	3.25	1.7965	1.8263	1.7979	1.8500	1.4250	2.6000	1.2500
1Y	1.7950	3.75	1.8195	1.8630	1.8293	1.9100	1.4575	2.5900	1.2200
1.5Y	1.8250	4.50	1.8530	1.9161	1.8784	2.0250	1.5025	2.5975	1.1900
2Y	1.8475	4.75	1.8800	1.9533	1.9114	2.1150	1.5350	2.6125	1.1675
3Y	1.8825	5.00	1.9160	1.9975	1.9569	2.2225	1.5950	2.6625	1.1550
4Y	1.9150	5.25	1.9465	2.0360	1.9966	2.2950	1.6300	2.7275	1.1575
5Y	1.9425	5.25	1.9760	2.0680	2.0288	2.3400	1.6625	2.7875	1.1575
7Y	1.9775	5.00	2.0130	2.1040	2.0689	2.3950	1.7050	2.8875	1.1675
10Y	2.0425	5.25	2.0775	2.1691	2.1340	2.4850	1.7825	3.0200	1.2125
12Y	2.0700	5.25	2.1050	2.2015	2.1705	2.5225	1.8175	3.0650	1.2150
15Y	2.0725	5.25	2.1060	2.2063	2.1812	2.5400	1.8250	3.1050	1.2150
20Y	2.0775	5.00	2.1130	2.2090	2.1872	2.5600	1.8250	3.2250	1.2150

6*9M	2.00	0.75	2.60	4.69	4.68	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	1.75	0.50	2.30	3.68	3.14	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	5.25	1.00	6.05	9.03	8.21	23.00	4.25	23.00	-5.50
2*3Y	3.50	0.25	3.60	4.43	4.55	13.25	3.25	13.25	-1.75
2*4Y	6.75	0.50	6.65	8.28	8.52	21.75	6.25	23.50	-1.75
2*5Y	9.50	0.50	9.60	11.48	11.73	27.25	9.00	34.00	-1.75
3*4Y	3.25	0.25	3.05	3.85	3.97	8.50	3.00	11.25	-0.50
3*5Y	6.00	0.25	6.00	7.05	7.19	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	2.75	0.00	2.95	3.20	3.22	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.50	-0.25	3.70	3.60	4.02	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	0.00	10.15	10.11	10.52	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.25	6.45	6.51	6.50	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	3.24	3.65	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.00	2.85	3.71	4.73	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	-0.25	3.55	3.99	5.32	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	3.20	1.894	1.894	1.847	1.935	1.400	2.548	1.237
1.5Y	1.920	3.40	1.933	1.965	1.918	2.113	1.523	2.575	1.232
2Y	1.940	4.60	1.959	1.999	1.959	2.230	1.597	2.607	1.225
3Y	1.932	5.00	1.954	2.014	1.991	2.315	1.655	2.650	1.200
4Y	2.008	5.60	2.036	2.126	2.105	2.502	1.782	2.767	1.232
5Y	2.045	6.60	2.068	2.171	2.174	2.602	1.847	2.862	1.217
7Y	2.149	6.40	2.169	2.273	2.288	2.728	2.024	2.996	1.270
10Y	2.222	6.20	2.242	2.344	2.365	2.815	2.115	3.158	1.355
20Y	2.172	4.40	2.193	2.291	2.320	2.792	2.128	3.340	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.49	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.79	-0.17	108.94	108.95	108.78
LKTB	124.73	-0.57	125.21	125.25	124.73

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	-9.10	0.55	-7.41	-3.05	-1.81	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-9.50	1.10	-7.98	-4.93	-4.00	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-9.25	0.15	-7.92	-4.60	-4.78	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.95	0.00	-3.82	-1.66	-3.43	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-9.30	-0.35	-8.97	-9.02	-10.89	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.25	-1.35	-9.22	-10.34	-14.52	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.15	-1.40	-15.64	-16.91	-21.87	-13.95	-35.15	-4.00	-37.65
10Y	-17.95	-0.95	-16.41	-17.53	-23.09	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-9.45	0.60	-8.04	-8.22	-13.29	-5.50	-39.75	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1139.20 (-2.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-48.00	-0.75	1Y	1.3150	3.00	1.6200	0.8250	1*2Y	-9.50	1.00		
-57.50	-1.50	1.5Y	1.2500	3.00	1.6600	0.8800	2*3Y	-1.00	1.50		
-62.75	-0.75	2Y	1.2200	4.00	1.6950	0.9450	2*5Y	6.00	1.50		
-67.25	0.50	3Y	1.2100	5.50	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	0.00		
-69.50	0.25	4Y	1.2200	5.50	1.8000	1.0700	3*5Y	7.00	0.00		
-66.25	0.25	5Y	1.2800	5.50	1.8500	1.1200	4*5Y	6.00	0.00		
-63.25	0.50	7Y	1.3450	5.50	1.8950	1.1500	5*7Y	6.50	0.00		
-50.75	0.25	10Y	1.5350	5.50	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	2.8588	0.0363	2.8225	2.8105	2.8510	2.9124	1.2620	2.9124	0.3100
10Y	3.1222	0.0349	3.0873	3.0788	3.1210	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	91.88	-0.97	92.85	82.55	86.40	94.22	-53.43	94.22	-210.20
10Y	90.02	-2.71	92.73	82.68	84.90	92.73	-24.46	92.73	-76.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	19.50	0.50	19.00	19.25	20.25	42.50	19.00	62.75	2.75
KTb 2*10Y	28.20	1.60	26.60	26.70	28.50	63.50	26.60	82.90	11.80
UST 2*10Y	26.34	-0.14	26.48	26.83	27.00	98.63	18.51	210.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M	75.5								
09M									
01Y	78.5 / 79.75								
1.5Y	80 / 81.5								
02Y	82 / 82.25 / 83.25								
03Y	87.25 / 87.75								
04Y	90.5	SPRD	3*5Y	06					
05Y	92.25 / 93 / 93.5		3*10Y	16					
07Y			5*10Y	10					
10Y			6*20Y	11.75					
12Y			7*10Y	07					
15Y			10*12Y	2.75					
20Y			10*15Y	3.5					
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	169 건	35	134	165	149	127	84	55	
금 액	61,663 억원	21,400	40,263	62,515	53,245	37,035	16,952	16,040	

장중동향

국고채 금리, 금리 상승 마감.

코스피 지수가 2000선 위로 올라온 가운데 예상보다 부진한 국고 30년물 입찰 영향.

IRS, 주식시장이 반등에 나서며 전일 금리 하락을 일부 되돌리며 금리 상승 마감.

이미 CD금리 근치까지 금리가 내려오면서 다시 비드가 유입되는 상황.

CRS도 금리 상승.