IPS Daily Morning Brief

2018-11-01

종가 기준일 2018-10-31

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7575	0.00	1.7620	1.7790	1.7515	1.8075	1.3950	2.5975	1.2875
9M	1.7825	0.50	1.7855	1.8243	1.7978	1.8500	1.4250	2.5800	1.2500
1Y	1.8000	0.50	1.8045	1.8599	1.8288	1.9100	1.4575	2.5675	1.2200
1.5Y	1.8350	1.00	1.8365	1.9116	1.8774	2.0250	1.5025	2.5750	1.1900
2Y	1.8700	2.25	1.8635	1.9488	1.9102	2.1150	1.5350	2.5850	1.1675
3Y	1.9050	2.25	1.8985	1.9925	1.9551	2.2225	1.5950	2.6400	1.1550
4Y	1.9400	2.50	1.9300	2.0309	1.9945	2.2950	1.6300	2.7125	1.1575
5Y	1.9700	2.75	1.9590	2.0630	2.0264	2.3400	1.6625	2.7800	1.1575
7Y	2.0075	3.00	1.9960	2.0991	2.0663	2.3950	1.7050	2.8850	1.1675
10Y	2.0725	3.00	2.0600	2.1643	2.1313	2.4850	1.7825	3.0200	1.2125
12Y	2.1000	3.00	2.0875	2.1960	2.1677	2.5225	1.8175	3.0650	1.2150
15Y	2.1025	3.00	2.0890	2.2004	2.1780	2.5400	1.8250	3.1050	1.2150
20Y	2.1075	3.00	2.0955	2.2031	2.1839	2.5600	1.8250	3.2250	1.2150

6*9M	2.50	0.50	2.35	4.53	4.63	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	1.75	0.00	1.90	3.56	3.10	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	7.00	1.75	5.90	8.89	8.13	23.00	4.25	23.00	-5.50
2*3Y	3.50	0.00	3.50	4.38	4.49	13.25	3.25	13.25	-1.75
2*4Y	7.00	0.25	6.65	8.21	8.43	21.75	6.25	23.50	-1.75
2*5Y	10.00	0.50	9.55	11.43	11.63	27.25	9.00	34.00	-1.75
3*4Y	3.50	0.25	3.15	3.84	3.94	8.50	3.00	11.25	-0.50
3*5Y	6.50	0.50	6.05	7.05	7.13	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.00	0.25	2.90	3.21	3.19	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.75	0.25	3.70	3.61	3.99	7.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.25	0.25	10.10	10.13	10.49	17.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.40	6.51	6.50	9.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	3.18	3.64	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.00	2.90	3.61	4.68	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	0.00	3.55	3.89	5.26	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.887	0.10	1.891	1.894	1.848	1.935	1.400	2.535	1.237
1.5Y	1.920	0.00	1.927	1.964	1.918	2.113	1.523	2.545	1.232
2Y	1.939	-0.10	1.949	1.996	1.958	2.230	1.597	2.560	1.225
3Y	1.942	1.00	1.943	2.010	1.989	2.315	1.655	2.610	1.200
4Y	2.036	2.80	2.024	2.121	2.103	2.502	1.782	2.767	1.232
5Y	2.075	3.00	2.056	2.166	2.170	2.602	1.847	2.837	1.217
7Y	2.174	2.50	2.158	2.267	2.283	2.728	2.024	2.996	1.270
10Y	2.245	2.30	2.230	2.338	2.360	2.815	2.115	3.155	1.355
20Y	2.192	2.00	2.182	2.283	2.314	2.792	2.128	3.340	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.70	0.00
CALL	1.56	7.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.72	-0.07	108.80	108.87	108.72
LKTB	124.46	-0.27	124.78	124.98	124.41

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	-8.70	0.40	-8.65	-3.37	-1.93	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-8.50	1.00	-9.09	-5.24	-4.06	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-6.90	2.35	-8.55	-4.77	-4.81	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-3.70	1.25	-4.41	-1.80	-3.40	0.30	-13.50	4.80	-19.50
4Y	-9.60	-0.30	-9.40	-8.98	-10.85	-6.70	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.50	-0.25	-9.72	-10.27	-14.35	-7.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-16.65	0.50	-16.18	-16.78	-21.67	-13.95	-35.15	-4.00	-37.65
10Y	-17.25	0.70	-17.02	-17.37	-22.84	-14.20	-37.50	-8.20	-38.70
20Y	-8.45	1.00	-8.63	-7.97	-13.06	-5.50	-39.75	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-45.50	2.50
-54.50	3.00
-60.50	2.25
-65.00	2.25
-68.00	1.50
-65.50	0.75
-62.75	0.50
-50.25	0.50

CRS

USD/KRW 1139.60 (+0.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3450	3.00	1.6200	0.8250	1*2Y	-8.00	1.50
1.5Y	1.2900	4.00	1.6600	0.8800	2*3Y	-1.00	0.00
2Y	1.2650	4.50	1.6950	0.9450	2*5Y	5.00	-1.00
3Y	1.2550	4.50	1.7550	0.9850	3*4Y	0.50	-0.50
4Y	1.2600	4.00	1.8000	1.0700	3*5Y	6.00	-1.00
5Y	1.3150	3.50	1.8500	1.1200	4*5Y	5.50	-0.50
7Y	1.3800	3.50	1.8950	1.1500	5*7Y	6.50	0.00
10Y	1.5700	3.50	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	0.0000	2.8588	2.8225	2.8105	2.9124	1.2620	2.9124	0.3100
10Y	3.1222	0.0000	3.1222	3.0873	3.0788	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	91.98	0.1	91.88	92.85	82.55	94.22	-53.43	94.22	-210.20
10Y	87.72	-2.30	90.02	92.73	82.68	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	20.25	0.75	19.50	19.00	19.25	42.50	19.00	62.75	2.75
KTB 2*10Y	30.60	2.40	28.20	26.60	26.70	63.50	26.60	82.90	11.80
UST 2*10Y	26.34	0.00	26.34	26.48	26.83	98.63	18.51	209.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	74.25 / 74.5 / 765	ODD Tenor	
09M			
01Y	78 / 79 / 79.25 / 79.5 / 79.75		
1.5Y	81 / 82.75		
02Y	83 / 83.25 / 84.75 / 85.25 / 86 / 87	SPRD	6*12m 04
03Y	88 / 90.5		1*2y 07
04Y	92.5 / 92.75		2*7y 13.5
05Y	92.5 / 92.75 / 97.25		3*7y 10
07Y	0.5 / 0.75		5*7y 3.75
10Y	2.5 / 6.75 / 07 / 7.25		5*10y 10.25
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y 33.5, 35 / 2y 25, 26, 26.5 / 3y 25 / 4y 25 / 5y 31, 31.5		

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	112 건	-57	169	134	165	149	127	84
금 액	32,865 억원	-28,798	61,663	40,263	62,515	53,245	37,035	16,952

장중동향

채권 금리상승.

최근 채권은 주가지수에 연동되어 움직이는 분위기. 강세 출발한 채권선물은 주가 상승폭이 커지면서 약해져.

IRS 레벨상승. 커브 스티프닝.

주식시장의 반등에 힘입어 채권이 약세를 보이면서 IRS금리도 장기물을 중심으로 상승. 전구간 비드가 오퍼를 찾는 분위기. 스프레드 비드들이 올라오면서 커브도 스팁.

CRS는 부채스와프 헷지 수요가 유입되며 상승 마감.