IPS Daily Morning Brief

2018-09-20

종가 기준일 2018-09-19

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7450	0.00	1.7435	1.7318	1.7255	1.7575	1.3900	2.6525	1.2875
9M	1.7975	0.25	1.7900	1.7744	1.7775	1.8300	1.4100	2.6650	1.2500
1Y	1.8325	0.75	1.8185	1.7980	1.8125	1.9100	1.4350	2.6800	1.2200
1.5Y	1.8850	2.00	1.8560	1.8369	1.8715	2.0250	1.4700	2.7250	1.1900
2Y	1.9175	2.75	1.8825	1.8621	1.9138	2.1150	1.5000	2.7675	1.1675
3Y	1.9650	3.25	1.9235	1.9021	1.9705	2.2225	1.5550	2.8500	1.1550
4Y	2.0075	3.50	1.9610	1.9390	2.0144	2.2950	1.6050	2.9200	1.1575
5Y	2.0375	3.75	1.9895	1.9701	2.0496	2.3400	1.6475	2.9775	1.1575
7Y	2.0850	3.75	2.0340	2.0133	2.0914	2.3950	1.7050	3.0675	1.1675
10Y	2.1600	4.00	2.1025	2.0778	2.1550	2.4850	1.7825	3.1875	1.2125
12Y	2.2000	4.00	2.1425	2.1164	2.1940	2.5225	1.8175	3.2300	1.2150
15Y	2.2125	4.00	2.1550	2.1291	2.2137	2.5400	1.8250	3.2675	1.2150
20Y	2.2200	4.00	2.1625	2.1384	2.2283	2.5600	1.8250	3.3875	1.2150

6*9M	5.25	0.25	4.65	4.26	5.20	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	3.50	0.50	2.85	2.36	3.50	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	8.50	2.00	6.40	6.41	10.13	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	4.75	0.50	4.10	4.00	5.68	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	9.00	0.75	7.85	7.69	10.06	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	12.00	1.00	10.70	10.80	13.58	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.25	0.25	3.75	3.69	4.39	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.25	0.50	6.60	6.80	7.91	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.00	0.25	2.85	3.11	3.52	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	4.45	4.31	4.18	8.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	12.25	0.25	11.30	10.76	10.53	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.50	0.25	6.85	6.45	6.35	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.86	3.90	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.25	5.14	5.88	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	6.00	0.00	6.00	6.06	7.34	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.857	1.40	1.835	1.796	1.826	1.935	1.400	2.671	1.237
1.5Y	1.920	2.30	1.891	1.859	1.915	2.113	1.517	2.716	1.232
2Y	1.960	2.80	1.924	1.898	1.977	2.230	1.577	2.780	1.225
3Y	1.997	2.50	1.963	1.941	2.031	2.315	1.617	2.837	1.200
4Y	2.145	3.80	2.098	2.049	2.145	2.502	1.760	2.955	1.232
5Y	2.185	3.80	2.135	2.125	2.250	2.602	1.830	3.072	1.217
7Y	2.301	3.80	2.251	2.245	2.374	2.728	2.024	3.160	1.270
10Y	2.375	4.00	2.321	2.316	2.458	2.815	2.115	3.380	1.355
20Y	2.327	4.50	2.262	2.262	2.432	2.792	2.176	3.551	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.53	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.39	-0.10	108.41	108.46	108.39
LKTB	122.97	-0.43	123.12	123.21	122.97

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	-2.45	-0.65	-1.65	0.22	-1.31	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-3.50	-0.30	-3.52	-2.18	-4.34	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-4.25	-0.05	-4.13	-3.55	-6.30	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-3.20	0.75	-3.97	-3.88	-6.08	-2.25	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-13.75	-0.30	-13.68	-11.04	-13.05	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-14.75	-0.05	-14.57	-15.44	-20.05	-13.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.60	-0.05	-21.68	-23.16	-28.29	-20.85	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-21.50	0.00	-21.89	-23.84	-30.35	-20.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-10.70	-0.50	-9.97	-12.41	-20.36	-7.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-51.75	-1.75
-62.00	-3.00
-68.25	-3.75
-73.00	-4.25
-74.75	-4.50
-73.25	-4.25
-74.00	-4.25
-62.00	-4.50

CRS

USD/KRW 1121.10 (-2.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3150	-1.00	1.6200	0.8050	1*2Y	-8.00	0.00
1.5Y	1.2650	-1.00	1.6600	0.8600	2*3Y	0.00	0.00
2Y	1.2350	-1.00	1.6950	0.9250	2*5Y	7.00	0.50
3Y	1.2350	-1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	2.50	0.00
4Y	1.2600	-1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	7.00	0.50
5Y	1.3050	-0.50	1.8500	1.0800	4*5Y	4.50	0.50
7Y	1.3450	-0.50	1.8950	1.1050	5*7Y	4.00	0.00
10Y	1.5400	-0.50	2.0500	1.2200	5*10Y	23.50	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	2.8032	-0.0040	2.8072	2.7737	2.7901	2.8072	1.2458	2.8072	0.3100
10Y	3.0676	0.0102	3.0574	2.9898	2.9999	3.1131	2.0387	3.1131	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	84.32	-3.2	87.52	84.37	87.51	88.61	-53.43	88.61	-243.20
10Y	69.26	-2.98	72.24	66.48	68.99	72.24	-24.46	72.24	-88.00

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	24.25	1.25	23.00	21.25	20.75	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	41.50	1.20	40.30	39.50	39.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	26.44	1.42	25.02	21.61	20.98	105.74	18.51	221.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6Y 5.25
06M	75 / 76 / 74.75		
09M	79.75		
01Y			
1.5Y			
02Y	91 / 90.75	SPRD	2*3Y 4.75
03Y	96.25 / 95.5 / 95.75		
04Y			
05Y	2.75 / 2.5		
07Y	08		
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y CCS 32.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	161 건	75	86	46	125	130	106	93
금 액	68,695 억원	46,245	22,450	19,960	49,885	61,201	34,310	23,625

장중동향

국고채 금리, 미 금리 상승 & 매파적 금통위 의사록 영향으로 금리 상승 마감.
전일 장 마감 후 공개된 한은 금통위 의사록에서 복수의 위원들이 '매파적' 의견을 낸 것으로 드러나며 시장에 금리인상 기대감 증대.
국채선물도 장중 내내 약세장에 머무름.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.
2Y-5Y 구간을 중심으로 거래.
CRS, 에셋 물량 영향을 받으며 금리 하락.