

IPS Daily Morning Brief

2018-09-04

종가 기준일 2018-09-03

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7350	0.75	1.7225	1.7284	1.7229	1.7575	1.3900	2.6550	1.2875
9M	1.7750	1.25	1.7720	1.7766	1.7828	1.8300	1.4100	2.6675	1.2500
1Y	1.7925	1.00	1.7970	1.8053	1.8236	1.9100	1.4350	2.6800	1.2200
1.5Y	1.8325	1.50	1.8405	1.8565	1.8920	2.0250	1.4700	2.7300	1.1900
2Y	1.8550	1.50	1.8690	1.8909	1.9427	2.1150	1.5000	2.7800	1.1675
3Y	1.8950	1.50	1.9105	1.9393	2.0079	2.2225	1.5550	2.8650	1.1550
4Y	1.9325	1.25	1.9490	1.9813	2.0565	2.2950	1.6050	2.9400	1.1575
5Y	1.9675	1.25	1.9840	2.0173	2.0940	2.3400	1.6475	3.0000	1.1575
7Y	2.0150	2.00	2.0270	2.0615	2.1362	2.3950	1.7050	3.1000	1.1675
10Y	2.0800	2.00	2.0895	2.1253	2.2001	2.4850	1.7825	3.2175	1.2125
12Y	2.1175	2.00	2.1270	2.1628	2.2393	2.5225	1.8175	3.2625	1.2150
15Y	2.1275	2.00	2.1390	2.1784	2.2620	2.5400	1.8250	3.3000	1.2150
20Y	2.1375	2.00	2.1490	2.1860	2.2813	2.5600	1.8250	3.4200	1.2150

6*9M	4.00	0.50	4.95	4.83	6.00	12.50	1.50	12.50	-6.00
9*12M	1.75	-0.25	2.50	2.86	4.08	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	6.25	0.50	7.20	8.56	11.91	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	4.00	0.00	4.15	4.84	6.52	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.75	-0.25	8.00	9.04	11.38	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	11.25	-0.25	11.50	12.64	15.13	27.25	10.50	34.00	-1.75
3*4Y	3.75	-0.25	3.85	4.20	4.86	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.25	-0.25	7.35	7.80	8.61	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.50	3.60	3.75	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.75	0.75	4.30	4.43	4.21	8.75	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.25	0.75	10.55	10.80	10.61	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.25	6.37	6.40	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.75	3.91	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.95	5.31	6.19	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	5.75	0.00	5.95	6.08	8.12	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.771	-0.80	1.796	1.815	1.842	1.935	1.400	2.673	1.237
1.5Y	1.842	0.40	1.860	1.896	1.947	2.113	1.517	2.725	1.232
2Y	1.875	0.50	1.900	1.949	2.018	2.230	1.577	2.785	1.225
3Y	1.925	1.50	1.950	1.998	2.079	2.315	1.617	2.855	1.200
4Y	2.015	1.50	2.045	2.097	2.200	2.502	1.760	3.005	1.232
5Y	2.105	0.30	2.145	2.212	2.315	2.602	1.830	3.120	1.217
7Y	2.232	-0.40	2.270	2.336	2.442	2.728	2.024	3.235	1.270
10Y	2.302	-0.80	2.340	2.426	2.528	2.815	2.115	3.460	1.355
20Y	2.260	-1.00	2.301	2.392	2.513	2.792	2.197	3.662	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.55	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.88	-0.03	108.87	108.92	108.85
LKTb	123.94	0.09	123.76	124.08	123.74

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	2.15	1.80	0.06	-1.02	-1.85	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-0.95	1.10	-1.97	-3.93	-5.47	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-2.00	1.00	-3.14	-5.85	-7.57	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-3.00	0.00	-3.95	-5.83	-7.08	-3.00	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-8.25	-0.25	-9.56	-11.58	-14.36	-8.00	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-13.75	0.95	-16.12	-19.46	-22.13	-13.45	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.70	2.40	-24.34	-27.50	-30.59	-21.70	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-22.20	2.80	-25.03	-30.12	-32.82	-22.20	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-12.25	3.00	-15.18	-20.59	-23.19	-12.25	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1110.30 (-2.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-53.75	0.50	1Y	1.2550	1.50	1.6200	0.8050	1*2Y	0.50	-0.50		
-57.75	-0.50	1.5Y	1.2550	1.00	1.6600	0.8600	2*3Y	2.50	0.00		
-59.50	-0.50	2Y	1.2600	1.00	1.6950	0.9250	2*5Y	10.50	-0.50		
-61.00	-0.50	3Y	1.2850	1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	3.00	-0.50		
-61.75	-0.75	4Y	1.3150	0.50	1.8000	1.0700	3*5Y	8.00	-0.50		
-60.25	-0.75	5Y	1.3650	0.50	1.8500	1.0800	4*5Y	5.00	0.00		
-62.00	-1.50	7Y	1.3950	0.50	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00		
-50.00	-1.50	10Y	1.5800	0.50	2.0500	1.2200	5*10Y	21.50	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	2.6330	0.0000	2.6330	2.6573	2.6734	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.8613	0.0000	2.8613	2.8568	2.8858	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	75.80	-0.5	76.30	72.03	76.34	76.34	-53.43	76.34	-245.00
10Y	55.93	0.80	55.13	49.18	52.08	55.93	-24.46	55.93	-89.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	22.50	0.50	22.00	22.25	22.50	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	42.70	-1.30	44.00	42.80	45.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	22.83	0.00	22.83	19.95	21.24	109.26	18.51	226.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	78.75								
1.5Y	82								
02Y	83.75 / 84.75 / 85	SPRD	9*12m 02						
03Y	88.75		1*2Y 6.25						
04Y			2*3Y 04						
05Y	96.5		3*10Y 18						
07Y									
10Y	06 / 6.25 / 7.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	67 건	-79	146	149	133	89	79	77	
금 액	20,740 억원	-42,710	63,450	49,280	39,684	29,060	19,360	20,440	

장중동향
국고채 금리, 혼조세 마감. 커브플래트닝.
3년 국채 선물은 약보합세, 10년 국채 선물은 강세로 마감.

IRS 금리, 상승.
구조화 물량 영향으로 장기 구간에서 비디쉬한 모습.

CRS 금리, 상승.