

IPS Daily Morning Brief

2018-09-06

종가 기준일 2018-09-05

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7300	-0.75	1.7295	1.7284	1.7234	1.7575	1.3900	2.6550	1.2875
9M	1.7625	-1.50	1.7710	1.7748	1.7821	1.8300	1.4100	2.6675	1.2500
1Y	1.7800	-1.75	1.7925	1.8009	1.8216	1.9100	1.4350	2.6800	1.2200
1.5Y	1.8150	-2.00	1.8315	1.8490	1.8882	2.0250	1.4700	2.7300	1.1900
2Y	1.8350	-2.25	1.8560	1.8805	1.9372	2.1150	1.5000	2.7800	1.1675
3Y	1.8750	-2.25	1.8970	1.9261	2.0004	2.2225	1.5550	2.8650	1.1550
4Y	1.9125	-2.25	1.9350	1.9666	2.0479	2.2950	1.6050	2.9400	1.1575
5Y	1.9400	-3.00	1.9685	2.0013	2.0848	2.3400	1.6475	2.9975	1.1575
7Y	1.9825	-3.25	2.0120	2.0448	2.1266	2.3950	1.7050	3.0975	1.1675
10Y	2.0375	-4.75	2.0755	2.1078	2.1903	2.4850	1.7825	3.2075	1.2125
12Y	2.0750	-4.50	2.1125	2.1451	2.2293	2.5225	1.8175	3.2525	1.2150
15Y	2.0875	-4.50	2.1235	2.1598	2.2515	2.5400	1.8250	3.2900	1.2150
20Y	2.0975	-4.50	2.1335	2.1671	2.2701	2.5600	1.8250	3.4100	1.2150

6*9M	3.25	-0.75	4.15	4.64	5.87	12.50	1.75	12.50	-6.00
9*12M	1.75	-0.25	2.15	2.61	3.95	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	5.50	-0.50	6.35	7.96	11.55	23.00	5.50	23.00	-5.50
2*3Y	4.00	0.00	4.10	4.56	6.32	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.75	0.00	7.90	8.61	11.07	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	10.50	-0.75	11.25	12.08	14.76	27.25	10.50	34.00	-1.75
3*4Y	3.75	0.00	3.80	4.05	4.75	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	6.50	-0.75	7.15	7.51	8.44	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	2.75	-0.75	3.35	3.46	3.69	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.25	-0.25	4.35	4.35	4.18	8.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.75	-1.75	10.70	10.65	10.55	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	5.50	-1.50	6.35	6.30	6.36	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.25	3.70	3.74	3.90	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.00	0.25	4.80	5.20	6.13	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	6.00	0.25	5.80	5.94	7.99	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.757	-0.10	1.779	1.806	1.839	1.935	1.400	2.673	1.237
1.5Y	1.826	-1.00	1.847	1.884	1.940	2.113	1.517	2.725	1.232
2Y	1.857	-2.30	1.884	1.935	2.010	2.230	1.577	2.785	1.225
3Y	1.898	-2.20	1.929	1.981	2.069	2.315	1.617	2.855	1.200
4Y	1.988	-2.30	2.019	2.078	2.187	2.502	1.760	3.005	1.232
5Y	2.077	-3.00	2.114	2.189	2.302	2.602	1.830	3.117	1.217
7Y	2.199	-3.70	2.240	2.313	2.428	2.728	2.024	3.225	1.270
10Y	2.265	-4.30	2.310	2.400	2.514	2.815	2.115	3.451	1.355
20Y	2.202	-5.30	2.262	2.361	2.497	2.792	2.197	3.648	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.49	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.97	0.09	108.87	108.97	108.86
LKTb	124.34	0.42	123.83	124.34	123.83

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	2.30	-1.65	1.33	-0.54	-1.72	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-1.10	-1.00	-1.57	-3.46	-5.22	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-2.20	0.05	-2.78	-5.50	-7.31	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-2.30	-0.05	-3.16	-5.49	-6.81	-2.25	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-7.55	0.05	-8.40	-11.17	-13.96	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-13.70	0.00	-14.51	-18.77	-21.73	-13.45	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.65	0.45	-22.84	-26.82	-30.17	-21.65	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-22.75	-0.45	-23.45	-29.18	-32.38	-22.20	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-10.45	0.80	-12.87	-19.40	-22.72	-10.45	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1121.50 (+6.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-49.50	1.75	1Y	1.2850	0.00	1.6200	0.8050	1*2Y	-2.00	-1.00		
-54.50	1.50	1.5Y	1.2700	-0.50	1.6600	0.8600	2*3Y	1.50	-0.50		
-57.00	1.25	2Y	1.2650	-1.00	1.6950	0.9250	2*5Y	7.50	-2.00		
-59.50	0.75	3Y	1.2800	-1.50	1.7550	0.9850	3*4Y	2.00	-1.00		
-61.25	-0.25	4Y	1.3000	-2.50	1.8000	1.0700	3*5Y	6.00	-1.50		
-60.00	0.00	5Y	1.3400	-3.00	1.8500	1.0800	4*5Y	4.00	-0.50		
-61.25	0.25	7Y	1.3700	-3.00	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00		
-48.25	1.75	10Y	1.5550	-3.00	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	2.6574	0.0000	2.6574	2.6330	2.6330	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.8985	0.0000	2.8985	2.8613	2.8613	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	80.04	2.3	77.74	75.80	76.30	80.04	-53.43	80.04	-245.00
10Y	63.35	4.30	59.05	55.93	55.13	63.35	-24.46	63.35	-89.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	20.25	-2.50	22.75	22.50	22.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	40.80	-2.00	42.80	42.70	44.00	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	24.11	0.00	24.11	22.83	22.83	106.52	18.51	226.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	82 / 83.5								
02Y	86				SPRD				
03Y	89.75								
04Y									
05Y	94.25 / 97								
07Y									
10Y	3.75 / 08								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	102 건		-50	152	67	146	149	133	89
금 액	26,810 억원		-35,808	62,618	20,740	63,450	49,280	39,684	29,060

장중동향

채권 금리하락 커브플랫 마감.

오전네 보험권을 맴돌던 채권은 오후들어 신흥국 불안과 미중무역분쟁등의 이슈가 부각되며 감세. 환율이 오르고, 증시가 하락하면서 급등 마감.

IRS도 레벨하락 커브 플랫.

아웃라잇 비드가 많던 IRS는 선물이 오르면서 오퍼리시하게 바뀌어 레벨이 크게 하락. 비디시하게 버티던 장기쪽이 오퍼가 나오자 커브가 크게 플랫.