

IPS Daily Morning Brief

2018-09-10

종가 기준일 2018-09-07

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7300	-0.25	1.7330	1.7281	1.7231	1.7575	1.3900	2.6550	1.2875
9M	1.7600	-0.50	1.7680	1.7729	1.7800	1.8300	1.4100	2.6675	1.2500
1Y	1.7750	-0.75	1.7855	1.7973	1.8183	1.9100	1.4350	2.6800	1.2200
1.5Y	1.8125	-0.75	1.8230	1.8429	1.8832	2.0250	1.4700	2.7275	1.1900
2Y	1.8325	-0.75	1.8440	1.8724	1.9306	2.1150	1.5000	2.7750	1.1675
3Y	1.8725	-0.75	1.8840	1.9161	1.9921	2.2225	1.5550	2.8625	1.1550
4Y	1.9075	-1.00	1.9210	1.9553	2.0386	2.2950	1.6050	2.9325	1.1575
5Y	1.9350	-1.00	1.9515	1.9890	2.0751	2.3400	1.6475	2.9900	1.1575
7Y	1.9775	-1.25	1.9960	2.0321	2.1168	2.3950	1.7050	3.0850	1.1675
10Y	2.0425	-1.00	2.0595	2.0950	2.1803	2.4850	1.7825	3.1950	1.2125
12Y	2.0825	-1.00	2.0975	2.1326	2.2193	2.5225	1.8175	3.2375	1.2150
15Y	2.0950	-1.00	2.1095	2.1466	2.2410	2.5400	1.8250	3.2750	1.2150
20Y	2.1050	-0.75	2.1190	2.1541	2.2589	2.5600	1.8250	3.3950	1.2150

6*9M	3.00	-0.25	3.50	4.48	5.69	12.50	1.75	12.50	-6.00
9*12M	1.50	-0.25	1.75	2.44	3.83	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	5.75	0.00	5.85	7.51	11.23	23.00	5.50	23.00	-5.50
2*3Y	4.00	0.00	4.00	4.38	6.15	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.50	-0.25	7.70	8.29	10.80	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	10.25	-0.25	10.75	11.66	14.45	27.25	10.25	34.00	-1.75
3*4Y	3.50	-0.25	3.70	3.91	4.65	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	6.25	-0.25	6.75	7.29	8.30	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	2.75	0.00	3.05	3.38	3.65	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.25	-0.25	4.45	4.31	4.18	8.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.75	0.00	10.80	10.60	10.52	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.25	6.35	6.29	6.34	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	3.80	3.76	3.90	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.00	5.16	6.08	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	6.25	0.25	5.95	5.91	7.87	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	1.00	1.764	1.799	1.835	1.935	1.400	2.673	1.237
1.5Y	1.836	0.50	1.834	1.874	1.933	2.113	1.517	2.721	1.232
2Y	1.875	0.50	1.871	1.923	2.002	2.230	1.577	2.782	1.225
3Y	1.912	-0.50	1.914	1.968	2.059	2.315	1.617	2.850	1.200
4Y	1.996	-0.50	2.002	2.063	2.175	2.502	1.760	2.997	1.232
5Y	2.075	-1.00	2.090	2.169	2.289	2.602	1.830	3.110	1.217
7Y	2.196	-1.00	2.214	2.293	2.415	2.728	2.024	3.213	1.270
10Y	2.262	-1.30	2.282	2.376	2.500	2.815	2.115	3.442	1.355
20Y	2.200	-0.50	2.224	2.334	2.481	2.792	2.197	3.637	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.66	14.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.94	0.01	108.95	108.96	108.88
LKTb	124.30	0.09	124.35	124.43	124.19

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	0.40	-1.75	2.19	-0.19	-1.64	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-2.35	-1.25	-1.12	-3.08	-5.02	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-4.25	-1.25	-2.74	-5.11	-7.11	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-3.95	-0.25	-3.04	-5.16	-6.66	-2.25	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-8.85	-0.50	-8.12	-10.76	-13.62	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-14.00	0.00	-13.83	-18.04	-21.35	-13.45	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.85	-0.25	-21.78	-26.05	-29.77	-21.60	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-21.95	0.30	-22.29	-28.07	-31.96	-21.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-9.50	-0.25	-10.54	-18.00	-22.24	-9.25	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1122.80 (-1.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-47.00	5.25	1Y	1.3050	4.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-5.00	-3.00		
-53.75	3.75	1.5Y	1.2750	3.00	1.6600	0.8600	2*3Y	0.50	-0.50		
-57.75	2.25	2Y	1.2550	1.50	1.6950	0.9250	2*5Y	5.50	-1.50		
-61.25	1.75	3Y	1.2600	1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	1.50	-0.50		
-63.25	1.50	4Y	1.2750	0.50	1.8000	1.0700	3*5Y	5.00	-1.00		
-62.50	1.00	5Y	1.3100	0.00	1.8500	1.0800	4*5Y	3.50	-0.50		
-63.75	1.25	7Y	1.3400	0.00	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00		
-51.75	1.00	10Y	1.5250	0.00	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	2.6985	0.0614	2.6371	2.6574	2.6574	2.6985	1.1686	2.6985	0.3100
10Y	2.9419	0.0639	2.8780	2.8985	2.8985	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	82.35	5.64	76.71	80.04	77.74	82.35	-53.43	82.35	-245.00
10Y	67.99	7.69	60.30	63.35	59.05	67.99	-24.46	67.99	-89.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	21.00	-0.25	21.25	20.25	22.75	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	38.70	-1.80	40.50	40.80	42.80	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	24.34	0.25	24.09	24.11	24.11	105.99	18.51	223.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	73.25								
09M									
01Y	77.75								
1.5Y	81.5								
02Y	83.75				SPRD	9*12m	02		
03Y	87.75					1*2y	06		
04Y	91					1.5*4y	9.75		
05Y				2*4y		7.75			
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	104 건	-28	132	102	152	67	146	149	
금 액	32,590 억원	-6,223	38,813	26,810	62,618	20,740	63,450	49,280	

장중동향

채권 강보합. 금리 하락.
뚜렷한 방향성을 보이지 않은 채권은 등락을 거듭하다 강보합마감. 단기는 더이상 강해지지 쉽지 않다는 인식에 금리 하락이 제한되며 커브 플랫.

IRS는 특별한 재료없이 외국인의 움직임에 연동해 하락 마감.

CRS는 1년구간이 크게 상승하며 커브가 큰폭으로 플랫.