IPS Daily Morning Brief

2018-09-11

종가 기준일 2018-09-10

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7300	0.00	1.7320	1.7278	1.7232	1.7575	1.3900	2.6550	1.2875
9M	1.7600	0.00	1.7650	1.7718	1.7792	1.8300	1.4100	2.6675	1.2500
1Y	1.7750	0.00	1.7820	1.7953	1.8169	1.9100	1.4350	2.6800	1.2200
1.5Y	1.8075	-0.50	1.8180	1.8394	1.8808	2.0250	1.4700	2.7275	1.1900
2Y	1.8275	-0.50	1.8385	1.8681	1.9276	2.1150	1.5000	2.7750	1.1675
3Y	1.8675	-0.50	1.8785	1.9110	1.9883	2.2225	1.5550	2.8575	1.1550
4Y	1.9000	-0.75	1.9145	1.9494	2.0343	2.2950	1.6050	2.9250	1.1575
5Y	1.9250	-1.00	1.9430	1.9826	2.0706	2.3400	1.6475	2.9825	1.1575
7Y	1.9650	-1.25	1.9860	2.0255	2.1123	2.3950	1.7050	3.0675	1.1675
10Y	2.0275	-1.50	2.0490	2.0886	2.1756	2.4850	1.7825	3.1875	1.2125
12Y	2.0675	-1.50	2.0875	2.1264	2.2146	2.5225	1.8175	3.2300	1.2150
15Y	2.0800	-1.50	2.1000	2.1403	2.2361	2.5400	1.8250	3.2675	1.2150
20Y	2.0900	-1.50	2.1095	2.1481	2.2537	2.5600	1.8250	3.3875	1.2150

6*9M	3.00	0.00	3.30	4.40	5.60	12.50	1.75	12.50	-6.00
9*12M	1.50	0.00	1.70	2.35	3.78	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	5.25	-0.50	5.65	7.29	11.07	23.00	5.25	23.00	-5.50
2*3Y	4.00	0.00	4.00	4.29	6.07	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.25	-0.25	7.60	8.13	10.68	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	9.75	-0.50	10.45	11.45	14.30	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	3.25	-0.25	3.60	3.84	4.60	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	5.75	-0.50	6.45	7.16	8.23	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	2.50	-0.25	2.85	3.33	3.63	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	-0.25	4.30	4.29	4.18	8.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.25	-0.50	10.60	10.60	10.50	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	-0.25	6.30	6.31	6.33	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	3.85	3.78	3.90	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.10	5.16	6.05	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	6.25	0.00	6.05	5.95	7.81	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.778	0.70	1.765	1.796	1.833	1.935	1.400	2.673	1.237
1.5Y	1.841	0.50	1.834	1.869	1.930	2.113	1.517	2.721	1.232
2Y	1.877	0.20	1.872	1.917	1.998	2.230	1.577	2.782	1.225
3Y	1.912	0.00	1.912	1.961	2.054	2.315	1.617	2.847	1.200
4Y	2.035	3.90	2.006	2.057	2.170	2.502	1.760	2.982	1.232
5Y	2.075	0.00	2.084	2.159	2.282	2.602	1.830	3.087	1.217
7Y	2.188	-0.80	2.205	2.282	2.408	2.728	2.024	3.190	1.270
10Y	2.252	-1.00	2.272	2.363	2.493	2.815	2.115	3.407	1.355
20Y	2.176	-2.40	2.208	2.320	2.474	2.792	2.176	3.586	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.58	-8.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.95	0.01	108.90	108.96	108.89
LKTB	124.50	0.20	124.11	124.53	124.10

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	-0.30	-0.70	1.70	-0.09	-1.60	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-3.35	-1.00	-1.60	-2.94	-4.93	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-4.95	-0.70	-3.33	-4.92	-7.02	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.45	-0.50	-3.33	-4.97	-6.60	-2.25	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-13.50	-4.65	-9.17	-10.75	-13.52	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-15.00	-1.00	-14.08	-17.66	-21.17	-13.45	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.30	-0.45	-21.90	-25.65	-29.58	-21.60	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-22.45	-0.50	-22.34	-27.48	-31.76	-21.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-8.60	0.90	-9.81	-17.17	-21.98	-8.60	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-46.50	0.50
-53.25	0.50
-57.75	0.00
-61.25	0.00
-63.50	-0.25
-63.00	-0.50
-64.00	-0.25
-51.75	0.00

CRS

USD/KRW 1128.40 (+5.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3100	0.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-6.00	-1.00
1.5Y	1.2750	0.00	1.6600	0.8600	2*3Y	0.50	0.00
2Y	1.2500	-0.50	1.6950	0.9250	2*5Y	4.50	-1.00
3Y	1.2550	-0.50	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	-0.50
4Y	1.2650	-1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	4.00	-1.00
5Y	1.2950	-1.50	1.8500	1.0800	4*5Y	3.00	-0.50
7Y	1.3250	-1.50	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00
10Y	1.5100	-1.50	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	2.7108	0.0123	2.6985	2.6371	2.6574	2.7108	1.1686	2.7108	0.3100
10Y	2.9355	-0.0064	2.9419	2.8780	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	83.38	1.03	82.35	76.71	80.04	83.38	-53.43	83.38	-245.00
10Y	68.35	0.36	67.99	60.30	63.35	68.35	-24.46	68.35	-89.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	20.00	-1.00	21.00	21.25	20.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	37.50	-1.20	38.70	40.50	40.80	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	22.47	-1.87	24.34	24.09	24.11	105.99	18.51	221.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	73.25 / 73.5	ODD Tenor	
09M			
01Y	775 / 77.75 / 78		
1.5Y	81.75		
02Y	82.75 / 83.5 / 83.75	SPRD	1*1.5y 3.5
03Y	86.5		1*20y 20.25
04Y	90		2*3y 4.5
05Y	92.5 / 93 / 93.25		5*10y 10.25 / 11
07Y			
10Y	2.5 / 2.75 / 3.5 / 5.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y 34		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	60 건	-44	104	132	102	152	67	146
금 액	18,025 억원	-14,565	32,590	38,813	26,810	62,618	20,740	63,450

장중동향

채권 계속되는 강세로 금리하락.
국채선물 롤오버가 가까워지면서 채권은 강세를 유지했고 외국인들도 10년선물을 꾸준히 매수하고 있어서 당분간 하락하기는 어려울것으로 전망.

IRS는 레벨하락 커브 플래트닝.
그동안의 활발했던 거래량에 비해 조용했던 분위기. 10년선물의 변동에따라 10년 거래가 많음.

CRS는 2년 뒤로 하락 커브 플랫마감.