

IPS Daily Morning Brief

2018-09-12

종가 기준일 2018-09-11

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7375	0.75	1.7320	1.7278	1.7235	1.7575	1.3900	2.6550	1.2875
9M	1.7675	0.75	1.7630	1.7710	1.7785	1.8300	1.4100	2.6675	1.2500
1Y	1.7875	1.25	1.7800	1.7939	1.8158	1.9100	1.4350	2.6800	1.2200
1.5Y	1.8225	1.50	1.8155	1.8366	1.8790	2.0250	1.4700	2.7275	1.1900
2Y	1.8425	1.50	1.8355	1.8646	1.9250	2.1150	1.5000	2.7750	1.1675
3Y	1.8825	1.50	1.8755	1.9066	1.9851	2.2225	1.5550	2.8575	1.1550
4Y	1.9175	1.75	1.9110	1.9444	2.0308	2.2950	1.6050	2.9250	1.1575
5Y	1.9450	2.00	1.9380	1.9773	2.0669	2.3400	1.6475	2.9825	1.1575
7Y	1.9825	1.75	1.9795	2.0198	2.1086	2.3950	1.7050	3.0675	1.1675
10Y	2.0475	2.00	2.0415	2.0833	2.1719	2.4850	1.7825	3.1875	1.2125
12Y	2.0875	2.00	2.0810	2.1211	2.2109	2.5225	1.8175	3.2300	1.2150
15Y	2.1000	2.00	2.0935	2.1349	2.2321	2.5400	1.8250	3.2675	1.2150
20Y	2.1100	2.00	2.1030	2.1431	2.2494	2.5600	1.8250	3.3875	1.2150

6*9M	3.00	0.00	3.10	4.33	5.50	12.50	1.75	12.50	-6.00
9*12M	2.00	0.50	1.70	2.29	3.73	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	5.50	0.25	5.55	7.08	10.92	23.00	5.25	23.00	-5.50
2*3Y	4.00	0.00	4.00	4.20	6.01	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.50	0.25	7.55	7.98	10.58	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	10.25	0.50	10.25	11.26	14.19	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	3.50	0.25	3.55	3.78	4.57	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	6.25	0.50	6.25	7.06	8.18	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	2.75	0.25	2.70	3.29	3.61	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.75	-0.25	4.15	4.25	4.17	8.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.25	0.00	10.35	10.60	10.50	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.25	6.20	6.35	6.33	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	3.95	3.79	3.90	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.20	5.16	6.03	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	6.25	0.00	6.15	5.99	7.75	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.788	1.00	1.771	1.794	1.831	1.935	1.400	2.673	1.237
1.5Y	1.852	1.10	1.837	1.864	1.927	2.113	1.517	2.721	1.232
2Y	1.885	0.80	1.873	1.912	1.994	2.230	1.577	2.782	1.225
3Y	1.922	1.00	1.912	1.954	2.050	2.315	1.617	2.847	1.200
4Y	2.047	1.20	2.013	2.051	2.165	2.502	1.760	2.982	1.232
5Y	2.090	1.50	2.080	2.150	2.277	2.602	1.830	3.087	1.217
7Y	2.205	1.67	2.199	2.272	2.403	2.728	2.024	3.190	1.270
10Y	2.270	1.80	2.265	2.352	2.488	2.815	2.115	3.407	1.355
20Y	2.197	2.10	2.196	2.307	2.467	2.792	2.176	3.586	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.53	-5.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.90	-0.05	108.94	108.97	108.88
LKTb	124.25	-0.25	124.45	124.53	124.19

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	-0.05	0.25	0.90	0.03	-1.55	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-2.95	0.40	-2.17	-2.78	-4.82	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-4.25	0.70	-3.73	-4.69	-6.93	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-3.95	0.50	-3.67	-4.76	-6.53	-2.25	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-12.95	0.55	-10.24	-10.71	-13.43	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-14.50	0.50	-14.24	-17.27	-21.01	-13.45	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.22	0.08	-21.92	-25.25	-29.40	-21.60	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-22.25	0.20	-22.33	-26.89	-31.56	-21.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-8.70	-0.10	-9.30	-16.35	-21.74	-8.60	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1125.30 (-3.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-49.75	-3.25	1Y	1.2900	-2.00	1.6200	0.8050	1*2Y	-5.50	0.50	
-56.25	-3.00	1.5Y	1.2600	-1.50	1.6600	0.8600	2*3Y	0.50	0.00	
-60.75	-3.00	2Y	1.2350	-1.50	1.6950	0.9250	2*5Y	4.50	0.00	
-64.25	-3.00	3Y	1.2400	-1.50	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	0.00	
-66.75	-3.25	4Y	1.2500	-1.50	1.8000	1.0700	3*5Y	4.00	0.00	
-66.50	-3.50	5Y	1.2800	-1.50	1.8500	1.0800	4*5Y	3.00	0.00	
-67.25	-3.25	7Y	1.3100	-1.50	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00	
-55.25	-3.50	10Y	1.4950	-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	2.7479	0.0371	2.7108	2.6985	2.6371	2.7479	1.1686	2.7479	0.3100
10Y	2.9786	0.0431	2.9355	2.9419	2.8780	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	86.29	2.91	83.38	82.35	76.71	86.29	-53.43	86.29	-245.00
10Y	70.86	2.51	68.35	67.99	60.30	70.86	-24.46	70.86	-89.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	20.50	0.50	20.00	21.00	21.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	38.50	1.00	37.50	38.70	40.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	23.07	0.60	22.47	24.34	24.09	105.99	18.51	221.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M									
09M	76								
01Y	77.75 / 78								
1.5Y	81.25								
02Y			SPRD	9*12m	1.75				
03Y									
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y 30.5								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	0 건		-60	60	104	132	102	152	67
금 액	0,000 억원		-18,025	18,025	32,590	38,813	26,810	62,618	20,740

장종동향

채권 금리 전구간 상승.
 시장은 뚜렷한 약세재료가 없는가운데 외국인의 국채선물 매도로 그간의 강세를 되돌리며 약세 마감.

IRS도 레벨 상승. 커브스티프닝
 국채선물이 하락한 영향으로 비드가 유입되면서 레벨상승했고 간간히 본드스왑 연와인딩 오퍼도 등장.

CRS는 중기구간 에셋스왑 프라이싱으로 하락.