

IPS Daily Morning Brief

2018-09-13

종가 기준일 2018-09-12

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7225	-1.50	1.7305	1.7269	1.7235	1.7575	1.3900	2.6550	1.2875
9M	1.7525	-1.50	1.7610	1.7693	1.7776	1.8300	1.4100	2.6675	1.2500
1Y	1.7700	-1.75	1.7780	1.7915	1.8144	1.9100	1.4350	2.6800	1.2200
1.5Y	1.8050	-1.75	1.8135	1.8329	1.8768	2.0250	1.4700	2.7275	1.1900
2Y	1.8225	-2.00	1.8330	1.8600	1.9220	2.1150	1.5000	2.7750	1.1675
3Y	1.8575	-2.50	1.8720	1.9009	1.9815	2.2225	1.5550	2.8575	1.1550
4Y	1.8950	-2.25	1.9075	1.9381	2.0268	2.2950	1.6050	2.9250	1.1575
5Y	1.9275	-1.75	1.9355	1.9709	2.0628	2.3400	1.6475	2.9825	1.1575
7Y	1.9675	-1.50	1.9765	2.0131	2.1045	2.3950	1.7050	3.0675	1.1675
10Y	2.0325	-1.50	2.0405	2.0770	2.1678	2.4850	1.7825	3.1875	1.2125
12Y	2.0725	-1.50	2.0805	2.1150	2.2068	2.5225	1.8175	3.2300	1.2150
15Y	2.0850	-1.50	2.0930	2.1286	2.2278	2.5400	1.8250	3.2675	1.2150
20Y	2.0950	-1.50	2.1025	2.1373	2.2447	2.5600	1.8250	3.3875	1.2150

6*9M	3.00	0.00	3.05	4.24	5.42	12.50	1.75	12.50	-6.00
9*12M	1.75	-0.25	1.70	2.23	3.68	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	5.25	-0.25	5.50	6.85	10.77	23.00	5.25	23.00	-5.50
2*3Y	3.50	-0.50	3.90	4.09	5.95	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.25	-0.25	7.45	7.81	10.48	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	10.50	0.25	10.25	11.09	14.08	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	3.75	0.25	3.55	3.73	4.53	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.00	0.75	6.35	7.00	8.13	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.50	2.80	3.28	3.60	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.25	4.10	4.23	4.17	8.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.50	0.25	10.50	10.61	10.50	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.40	6.39	6.33	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.80	3.90	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.25	5.16	6.00	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	6.25	0.00	6.20	6.03	7.68	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.776	-1.20	1.775	1.790	1.829	1.935	1.400	2.673	1.237
1.5Y	1.836	-1.60	1.839	1.859	1.924	2.113	1.517	2.721	1.232
2Y	1.862	-2.30	1.874	1.904	1.990	2.230	1.577	2.782	1.225
3Y	1.890	-3.20	1.911	1.946	2.046	2.315	1.617	2.847	1.200
4Y	2.020	-2.70	2.020	2.044	2.160	2.502	1.760	2.982	1.232
5Y	2.060	-3.00	2.077	2.139	2.271	2.602	1.830	3.087	1.217
7Y	2.180	-2.47	2.195	2.261	2.397	2.728	2.024	3.190	1.270
10Y	2.250	-2.00	2.262	2.340	2.481	2.815	2.115	3.407	1.355
20Y	2.180	-1.70	2.192	2.293	2.460	2.792	2.176	3.586	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.52	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.00	0.10	108.93	109.02	108.89
LKTb	124.48	0.23	124.30	124.51	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	-0.60	-0.55	0.32	0.13	-1.50	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-3.10	-0.15	-2.57	-2.60	-4.71	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-3.95	0.30	-4.08	-4.42	-6.83	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-3.25	0.70	-3.86	-4.48	-6.44	-2.25	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-12.50	0.45	-11.23	-10.61	-13.34	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-13.25	1.25	-14.15	-16.78	-20.84	-13.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.25	0.97	-21.84	-24.81	-29.21	-21.25	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-21.75	0.50	-22.13	-26.29	-31.36	-21.75	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-8.50	0.20	-8.91	-15.55	-21.50	-8.50	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1128.60 (+3.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-49.00	0.75	1Y	1.2800	-1.00	1.6200	0.8050	1*2Y	-7.00	-1.50	
-56.00	0.25	1.5Y	1.2450	-1.50	1.6600	0.8600	2*3Y	0.50	0.00	
-61.25	-0.50	2Y	1.2100	-2.50	1.6950	0.9250	2*5Y	4.50	0.00	
-64.25	0.00	3Y	1.2150	-2.50	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	0.00	
-67.00	-0.25	4Y	1.2250	-2.50	1.8000	1.0700	3*5Y	4.00	0.00	
-67.25	-0.75	5Y	1.2550	-2.50	1.8500	1.0800	4*5Y	3.00	0.00	
-68.25	-1.00	7Y	1.2850	-2.50	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00	
-56.25	-1.00	10Y	1.4700	-2.50	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	2.7481	0.0002	2.7479	2.7108	2.6985	2.7481	1.1686	2.7481	0.3100
10Y	2.9667	-0.0119	2.9786	2.9355	2.9419	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	88.61	2.32	86.29	83.38	82.35	88.61	-53.43	88.61	-245.00
10Y	71.67	0.81	70.86	68.35	67.99	71.67	-24.46	71.67	-88.00

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	21.00	0.50	20.50	20.00	21.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	38.80	0.30	38.50	37.50	38.70	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	21.86	-1.21	23.07	22.47	24.34	105.99	18.51	221.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS		ODD Tenor	6y 95.5 / 96							
06M	72.25		9y 01							
09M	75.75 / 76									
01Y	77.5 / 78.25 / 78.5									
1.5Y	81.75									
02Y	83 / 83.25 / 83.5		SPRD	6*9m 03						
03Y	87 / 87.5 / 86			2*5y 10.25						
04Y				5*7y 04						
05Y	93									
07Y										
10Y	2.5 / / 03 / 04 / 05									
12Y	7									
15Y										
20Y										
CRS	1.5y 24.5 / 4y 23 / 5y 28 / 1*2y -5.5 / 2*5y 4.5									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6		
거래현황	106 건	13	93	60	104	132	102	152		
금 액	34,310 억원	10,685	23,625	18,025	32,590	38,813	26,810	62,618		

장중동향
 채권 강세 금리 하락.
 개장전 발표된 금융위기 이후 8년내 최저치를 기록한 고용통계로 강세출발. 인플레이션 저속이 우려된다는 금통위원의 발언도 강세를 이끌.

IRS도 국채선물과 연동해 레벨 하락. 고용지표 부진과 신인석 금통위원의 비둘기 기조 발언으로 전테너하락했고, 1.5~5년 구간의 하락폭이 상대적으로 컸음.

CRS도 전체적으로 하락마감.