IPS Daily Morning Brief

2018-09-14

종가 기준일 2018-09-13

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7400	1.75	1.7320	1.7270	1.7238	1.7575	1.3900	2.6550	1.2875
9M	1.7750	2.25	1.7630	1.7688	1.7772	1.8300	1.4100	2.6675	1.2500
1Y	1.7950	2.50	1.7805	1.7909	1.8135	1.9100	1.4350	2.6800	1.2200
1.5Y	1.8250	2.00	1.8145	1.8309	1.8750	2.0250	1.4700	2.7275	1.1900
2Y	1.8450	2.25	1.8340	1.8573	1.9197	2.1150	1.5000	2.7750	1.1675
3Y	1.8825	2.50	1.8725	1.8971	1.9785	2.2225	1.5550	2.8575	1.1550
4Y	1.9175	2.25	1.9075	1.9339	2.0236	2.2950	1.6050	2.9250	1.1575
5Y	1.9475	2.00	1.9360	1.9665	2.0595	2.3400	1.6475	2.9825	1.1575
7Y	1.9875	2.00	1.9760	2.0088	2.1011	2.3950	1.7050	3.0675	1.1675
10Y	2.0525	2.00	2.0405	2.0728	2.1644	2.4850	1.7825	3.1875	1.2125
12Y	2.0925	2.00	2.0805	2.1109	2.2034	2.5225	1.8175	3.2300	1.2150
15Y	2.1050	2.00	2.0930	2.1244	2.2242	2.5400	1.8250	3.2675	1.2150
20Y	2.1125	1.75	2.1025	2.1333	2.2405	2.5600	1.8250	3.3875	1.2150

6*9M	3.50	0.50	3.10	4.18	5.35	12.50	1.75	12.50	-6.00
9*12M	2.00	0.25	1.75	2.21	3.63	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	5.00	-0.25	5.35	6.64	10.62	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	3.75	0.25	3.85	3.99	5.89	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.25	0.00	7.35	7.66	10.39	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	10.25	-0.25	10.20	10.93	13.98	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	3.50	-0.25	3.50	3.68	4.50	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	6.50	-0.50	6.35	6.94	8.09	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.00	-0.25	2.85	3.26	3.59	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.00	4.00	4.23	4.17	8.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.50	0.00	10.45	10.63	10.50	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.45	6.40	6.33	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.81	3.90	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.25	5.16	5.98	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	6.00	-0.25	6.20	6.05	7.61	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.801	2.50	1.783	1.788	1.828	1.935	1.400	2.673	1.237
1.5Y	1.856	2.00	1.844	1.855	1.921	2.113	1.517	2.721	1.232
2Y	1.882	2.00	1.876	1.898	1.987	2.230	1.577	2.782	1.225
3Y	1.920	3.00	1.911	1.939	2.042	2.315	1.617	2.847	1.200
4Y	2.045	2.50	2.029	2.039	2.156	2.502	1.760	2.982	1.232
5Y	2.082	2.20	2.076	2.130	2.266	2.602	1.830	3.087	1.217
7Y	2.196	1.60	2.193	2.252	2.391	2.728	2.024	3.190	1.270
10Y	2.262	1.20	2.259	2.329	2.476	2.815	2.115	3.407	1.355
20Y	2.190	1.00	2.189	2.281	2.453	2.792	2.176	3.586	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.90	-0.10	108.99	109.01	108.74
LKTB	124.36	-0.12	124.47	124.47	124.05

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	-0.60	0.00	-0.23	0.27	-1.46	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-3.10	0.00	-2.97	-2.38	-4.62	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-3.70	0.25	-4.22	-4.10	-6.72	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-3.75	-0.50	-3.87	-4.23	-6.36	-2.25	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-12.75	-0.25	-12.11	-10.52	-13.26	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-13.45	-0.20	-14.04	-16.32	-20.66	-13.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-20.85	0.40	-21.69	-24.35	-29.01	-20.85	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-20.95	0.80	-21.87	-25.67	-31.15	-20.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-7.75	0.75	-8.61	-14.80	-21.22	-7.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-45.50	3.50
-54.50	1.50
-60.50	0.75
-64.75	-0.50
-66.75	0.25
-66.75	0.50
-67.75	0.50
-55.75	0.50

CRS

USD/KRW 1122.40 (-6.20)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3400	6.00	1.6200	0.8050	1*2Y	-10.00	-3.00
1.5Y	1.2800	3.50	1.6600	0.8600	2*3Y	-0.50	-1.00
2Y	1.2400	3.00	1.6950	0.9250	2*5Y	4.00	-0.50
3Y	1.2350	2.00	1.7550	0.9850	3*4Y	1.50	0.50
4Y	1.2500	2.50	1.8000	1.0700	3*5Y	4.50	0.50
5Y	1.2800	2.50	1.8500	1.0800	4*5Y	3.00	0.00
7Y	1.3100	2.50	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00
10Y	1.4950	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	2.7606	0.0125	2.7481	2.7479	2.7108	2.7606	1.1806	2.7606	0.3100
10Y	2.9722	0.0055	2.9667	2.9786	2.9355	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	87.86	-0.75	88.61	86.29	83.38	88.61	-53.43	88.61	-245.00
10Y	71.02	-0.65	71.67	70.86	68.35	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	20.75	-0.25	21.00	20.50	20.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	38.00	-0.80	38.80	38.50	37.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	21.16	-0.70	21.86	23.07	22.47	105.99	18.51	221.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			9Y 2.5
06M		ODD Tenor	
09M	77.25		
01Y	79.5		
1.5Y			
02Y	82.75 / 85	SPRD	
03Y	88.75		
04Y			
05Y	93.25 / 93.5		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	130 건	24	106	93	60	104	132	102
금 액	61,201 억원	26,891	34,310	23,625	18,025	32,590	38,813	26,810

장중동향

국고채 금리, 총리 금리 발언의 영향을 받으며 금리 상승 마감.
이낙연 국무총리가 국회 대정부 질문에 출석해 "금리 인상 여부와 관련해 좀 더 심각하게 생각할 때가 충분히 됐다는 데 동의한다" 고 발언

IRS, 이낙연 국무총리 금리 인상 발언에 금리 상승.

CRS도 금리 상승 마감.