

IPS Daily Morning Brief

2018-09-17

종가 기준일 2018-09-14

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7425	0.25	1.7345	1.7278	1.7240	1.7575	1.3900	2.6550	1.2875
9M	1.7900	1.50	1.7690	1.7696	1.7771	1.8300	1.4100	2.6675	1.2500
1Y	1.8175	2.25	1.7890	1.7920	1.8130	1.9100	1.4350	2.6800	1.2200
1.5Y	1.8500	2.50	1.8220	1.8313	1.8737	2.0250	1.4700	2.7275	1.1900
2Y	1.8775	3.25	1.8430	1.8574	1.9178	2.1150	1.5000	2.7750	1.1675
3Y	1.9150	3.25	1.8810	1.8966	1.9760	2.2225	1.5550	2.8575	1.1550
4Y	1.9500	3.25	1.9160	1.9334	2.0207	2.2950	1.6050	2.9250	1.1575
5Y	1.9775	3.00	1.9445	1.9655	2.0564	2.3400	1.6475	2.9825	1.1575
7Y	2.0200	3.25	1.9845	2.0080	2.0980	2.3950	1.7050	3.0675	1.1675
10Y	2.0850	3.25	2.0490	2.0718	2.1613	2.4850	1.7825	3.1875	1.2125
12Y	2.1250	3.25	2.0890	2.1100	2.2003	2.5225	1.8175	3.2300	1.2150
15Y	2.1375	3.25	2.1015	2.1234	2.2208	2.5400	1.8250	3.2675	1.2150
20Y	2.1450	3.25	2.1105	2.1325	2.2367	2.5600	1.8250	3.3875	1.2150

6*9M	4.75	1.25	3.45	4.19	5.30	12.50	1.75	12.50	-6.00
9*12M	2.75	0.75	2.00	2.24	3.59	10.50	1.25	10.50	-4.25
1*2Y	6.00	1.00	5.40	6.54	10.48	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	3.75	0.00	3.80	3.93	5.83	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.25	0.00	7.30	7.60	10.30	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	10.00	-0.25	10.15	10.81	13.86	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	3.50	0.00	3.50	3.68	4.47	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	6.25	-0.25	6.35	6.89	8.04	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	2.75	-0.25	2.85	3.21	3.57	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.25	0.25	4.00	4.25	4.16	8.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.75	0.25	10.45	10.63	10.49	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.45	6.38	6.33	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.83	3.90	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.25	5.16	5.95	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	6.00	0.00	6.15	6.08	7.54	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.831	3.00	1.795	1.788	1.827	1.935	1.400	2.673	1.237
1.5Y	1.886	3.00	1.854	1.853	1.919	2.113	1.517	2.721	1.232
2Y	1.915	3.30	1.884	1.896	1.984	2.230	1.577	2.782	1.225
3Y	1.957	3.70	1.920	1.938	2.039	2.315	1.617	2.847	1.200
4Y	2.087	4.20	2.047	2.039	2.153	2.502	1.760	2.982	1.232
5Y	2.122	4.00	2.086	2.126	2.261	2.602	1.830	3.087	1.217
7Y	2.239	4.30	2.202	2.248	2.386	2.728	2.024	3.190	1.270
10Y	2.310	4.80	2.269	2.324	2.471	2.815	2.115	3.407	1.355
20Y	2.235	4.50	2.196	2.273	2.447	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	108.77	-0.13	108.87	108.89	108.74
LKTb	123.88	-0.48	124.29	124.35	123.79

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	-1.35	-0.75	-0.58	0.37	-1.42	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-3.60	-0.50	-3.22	-2.21	-4.56	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-3.75	-0.05	-4.12	-3.84	-6.61	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.20	-0.45	-3.92	-4.12	-6.30	-2.25	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-13.70	-0.95	-13.08	-10.58	-13.20	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-14.45	-1.00	-14.13	-16.03	-20.50	-13.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.90	-1.05	-21.70	-23.99	-28.84	-20.85	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-22.50	-1.55	-21.98	-25.19	-30.96	-20.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-9.00	-1.25	-8.51	-14.07	-21.00	-7.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1116.60 (-5.80)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-46.25	-0.75	1Y	1.3550	1.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-8.50	1.50
-55.00	-0.50	1.5Y	1.3000	2.00	1.6600	0.8600	2*3Y	-0.50	0.00
-60.75	-0.25	2Y	1.2700	3.00	1.6950	0.9250	2*5Y	4.00	0.00
-65.00	-0.25	3Y	1.2650	3.00	1.7550	0.9850	3*4Y	1.50	0.00
-67.00	-0.25	4Y	1.2800	3.00	1.8000	1.0700	3*5Y	4.50	0.00
-66.75	0.00	5Y	1.3100	3.00	1.8500	1.0800	4*5Y	3.00	0.00
-68.00	-0.25	7Y	1.3400	3.00	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00
-56.00	-0.25	10Y	1.5250	3.00	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	2.7901	0.0295	2.7606	2.7481	2.7479	2.7901	1.1884	2.7901	0.3100
10Y	2.9999	0.0277	2.9722	2.9667	2.9786	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	87.51	-0.35	87.86	88.61	86.29	88.61	-53.43	88.61	-245.00
10Y	68.99	-2.03	71.02	71.67	70.86	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	0.00	20.75	21.00	20.50	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	39.50	1.50	38.00	38.80	38.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	20.98	-0.18	21.16	21.86	23.07	105.99	18.51	221.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	80								
1.5Y									
02Y	85.5 / 87.5	SPRD	1*2Y 5.5						
03Y			1*1.5*2Y 01						
04Y									
05Y	96.5 / 97.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y CCS 22.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	125 건	-5	130	106	93	60	104	132	
금 액	49,885 억원	-11,316	61,201	34,310	23,625	18,025	32,590	38,813	

장종동향
국고채 금리, 부동산발 금리 인상 압박에 이틀째 금리 급등.
전일 이낙연 국무총리의 "금리 인상 여부와 관련해 좀 더 심각하게 생각할 때가 충분히 됐다는 데 동의한다"는 부동산발 인상론 발언 여파 지속

IRS, 일본 아베 총리 발언에 영향을 받으며 금리 상승.

CRS도 금리 상승 마감.