IPS Daily Morning Brief

2018-09-21

종가 기준일 2018-09-20

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7600	1.50	1.7475	1.7331	1.7264	1.7600	1.3900	2.6525	1.2875
9M	1.8150	1.75	1.7980	1.7761	1.7781	1.8300	1.4100	2.6650	1.2500
1Y	1.8550	2.25	1.8305	1.8004	1.8131	1.9100	1.4350	2.6800	1.2200
1.5Y	1.9100	2.50	1.8730	1.8399	1.8718	2.0250	1.4700	2.7250	1.1900
2Y	1.9500	3.25	1.9035	1.8655	1.9137	2.1150	1.5000	2.7675	1.1675
3Y	2.0150	5.00	1.9500	1.9068	1.9703	2.2225	1.5550	2.8500	1.1550
4Y	2.0625	5.50	1.9900	1.9443	2.0142	2.2950	1.6050	2.9200	1.1575
5Y	2.0950	5.75	2.0190	1.9753	2.0493	2.3400	1.6475	2.9775	1.1575
7Y	2.1400	5.50	2.0645	2.0184	2.0912	2.3950	1.7050	3.0675	1.1675
10Y	2.2125	5.25	2.1345	2.0833	2.1550	2.4850	1.7825	3.1875	1.2125
12Y	2.2525	5.25	2.1745	2.1220	2.1940	2.5225	1.8175	3.2300	1.2150
15Y	2.2650	5.25	2.1870	2.1346	2.2135	2.5400	1.8250	3.2675	1.2150
20Y	2.2725	5.25	2.1945	2.1438	2.2277	2.5600	1.8250	3.3875	1.2150
6*9M	5.50	0.25	5.05	4.30	5.17	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	4.00	0.50	3.25	2.43	3.50	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	9.50	1.00	7.30	6.51	10.06	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	6.50	1.75	4.65	4.13	5.66	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	11.25	2.25	8.65	7.88	10.05	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	14.50	2.50	11.55	10.98	13.56	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.75	0.50	4.00	3.75	4.38	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.00	0.75	6.90	6.85	7.90	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.25	2.90	3.10	3.52	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.50	-0.25	4.55	4.31	4.19	8.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.75	-0.50	11.55	10.80	10.56	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.25	-0.25	7.00	6.49	6.38	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.87	3.90	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.25	5.14	5.85	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	6.00	0.00	6.00	6.05	7.27	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.880	2.30	1.851	1.800	1.826	1.935	1.400	2.671	1.237
1.5Y	1.956	3.60	1.911	1.864	1.915	2.113	1.517	2.716	1.232
2Y	2.002	4.20	1.948	1.902	1.976	2.230	1.577	2.780	1.225
3Y	2.037	4.00	1.987	1.945	2.030	2.315	1.617	2.837	1.200
4Y	2.205	6.00	2.130	2.057	2.144	2.502	1.760	2.952	1.232
5Y	2.240	5.50	2.167	2.128	2.248	2.602	1.830	3.072	1.217
7Y	2.356	5.50	2.283	2.248	2.372	2.728	2.024	3.160	1.270
10Y	2.430	5.50	2.355	2.318	2.456	2.815	2.115	3.380	1.355
20Y	2.430	10.30	2.310	2.267	2.430	2.792	2.176	3.532	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.57	4.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.22	-0.17	108.40	108.41	108.22
LKTB	122.42	-0.55	122.99	123.10	122.42

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	-2.50	-0.05	-2.03	0.01	-1.28	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-4.60	-1.10	-3.82	-2.40	-4.28	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-5.20	-0.95	-4.43	-3.67	-6.22	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-2.20	1.00	-3.66	-3.78	-5.97	-2.20	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-14.25	-0.50	-13.98	-11.24	-13.01	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-14.50	0.25	-14.78	-15.25	-19.89	-13.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.60	0.00	-21.83	-22.94	-28.10	-20.85	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-21.75	-0.25	-22.05	-23.47	-30.13	-20.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-15.75	-5.05	-11.57	-12.30	-20.20	-7.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-51.50	0.25
-61.00	1.00
-67.50	0.75
-74.50	-1.50
-77.25	-2.50
-76.00	-2.75
-76.50	-2.50
-64.25	-2.25

CRS

USD/KRW 1120.40 (-0.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3400	2.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-6.50	1.50
1.5Y	1.3000	3.50	1.6600	0.8600	2*3Y	-0.50	-0.50
2Y	1.2750	4.00	1.6950	0.9250	2*5Y	6.00	-1.00
3Y	1.2700	3.50	1.7550	0.9850	3*4Y	2.00	-0.50
4Y	1.2900	3.00	1.8000	1.0700	3*5Y	6.50	-0.50
5Y	1.3350	3.00	1.8500	1.0800	4*5Y	4.50	0.00
7Y	1.3750	3.00	1.8950	1.1050	5*7Y	4.00	0.00
10Y	1.5700	3.00	2.0500	1.2200	5*10Y	23.50	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	2.8118	0.0086	2.8032	2.8072	2.7737	2.8118	1.2458	2.8118	0.3100
10Y	3.0639	-0.0037	3.0676	3.0574	2.9898	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	80.98	-3.34	84.32	87.52	84.37	88.61	-53.43	88.61	-243.20
10Y	63.39	-5.87	69.26	72.24	66.48	72.24	-24.46	72.24	-88.00

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	26.25	2.00	24.25	23.00	21.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	42.80	1.30	41.50	40.30	39.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	25.21	-1.23	26.44	25.02	21.61	105.74	18.51	221.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	74.5	ODD Tenor	6Y 08
09M			
01Y			
1.5Y	91 / 88.75 / 89		
02Y	92.25	SPRD	5*6Y 2.5
03Y	99.75 / 00 / 97		
04Y			
05Y	5.5 / 7.5 / 7.25		
07Y	12		
10Y			
12Y	24		
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	193 건	32	161	86	46	125	130	106
금 액	65,477 억원	-3,218	68,695	22,450	19,960	49,885	61,201	34,310

장중동향

국고채 금리, 외인이 국채 선물을 대량 매도하면서 금리 상승. 국고 3년 2% 돌파.
연내 금리 인상 가능성이 커지면서 매수 심리가 급격히 위축된 가운데 외인이 3선을 중심으로 대량 순매도.
올해 들어 하루 동안 가장 많이 매도. (외인 매도 3선 11,153 계약 / 10선 3,585 계약)

IRS, 전구간 금리 상승. 한은 금융안정보고서가 나온 후 국채선물이 밀리며 전 구간 비디쉬.
IRS 금리는 한 번 이상의 금리 인상을 이미 반영한 상태.
CRS도 전체적으로 금리 상승.