

IPS Daily Morning Brief

2018-09-27

종가 기준일 2018-09-26

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7500	-1.00	1.7540	1.7394	1.7296	1.7600	1.3900	2.6525	1.2875
9M	1.8050	-1.00	1.8090	1.7828	1.7808	1.8300	1.4100	2.6650	1.2500
1Y	1.8450	-1.00	1.8490	1.8095	1.8158	1.9100	1.4350	2.6750	1.2200
1.5Y	1.8975	-1.25	1.9025	1.8509	1.8734	2.0250	1.4700	2.7200	1.1900
2Y	1.9350	-1.50	1.9410	1.8781	1.9138	2.1150	1.5000	2.7675	1.1675
3Y	1.9900	-2.50	2.0000	1.9231	1.9692	2.2225	1.5550	2.8500	1.1550
4Y	2.0375	-2.50	2.0475	1.9628	2.0128	2.2950	1.6050	2.9200	1.1575
5Y	2.0700	-2.50	2.0800	1.9934	2.0478	2.3400	1.6475	2.9775	1.1575
7Y	2.1125	-2.75	2.1235	2.0365	2.0898	2.3950	1.7050	3.0675	1.1675
10Y	2.1825	-3.00	2.1945	2.1033	2.1541	2.4850	1.7825	3.1875	1.2125
12Y	2.2225	-3.00	2.2345	2.1425	2.1931	2.5225	1.8175	3.2300	1.2150
15Y	2.2350	-3.00	2.2470	2.1546	2.2116	2.5400	1.8250	3.2675	1.2150
20Y	2.2425	-3.00	2.2545	2.1633	2.2244	2.5600	1.8250	3.3875	1.2150

6*9M	5.50	0.00	5.50	4.34	5.12	12.50	2.00	12.50	-6.00
9*12M	4.00	0.00	4.00	2.68	3.50	10.50	1.50	10.50	-4.25
1*2Y	9.00	-0.50	9.20	6.86	9.80	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	5.50	-1.00	5.90	4.50	5.54	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	10.25	-1.00	10.65	8.46	9.90	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	13.50	-1.00	13.90	11.53	13.40	27.25	9.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.75	0.00	4.75	3.96	4.37	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.00	0.00	8.00	7.03	7.87	14.00	5.75	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.25	3.06	3.50	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.25	-0.25	4.35	4.31	4.19	8.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.25	-0.50	11.45	10.99	10.63	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	-0.25	7.10	6.68	6.44	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.92	3.90	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.25	5.14	5.75	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	6.00	0.00	6.00	6.00	7.03	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.879	-0.10	1.879	1.817	1.828	1.935	1.400	2.668	1.237
1.5Y	1.946	-1.00	1.950	1.882	1.913	2.113	1.517	2.716	1.232
2Y	1.982	-2.00	1.990	1.918	1.971	2.230	1.577	2.780	1.225
3Y	2.015	-2.20	2.024	1.957	2.023	2.315	1.617	2.837	1.200
4Y	2.172	-3.30	2.185	2.080	2.140	2.502	1.760	2.952	1.232
5Y	2.215	-2.50	2.225	2.138	2.239	2.602	1.830	3.072	1.217
7Y	2.332	-2.40	2.342	2.257	2.363	2.728	2.024	3.160	1.270
10Y	2.410	-2.00	2.418	2.328	2.447	2.815	2.115	3.380	1.355
20Y	2.385	-4.50	2.403	2.280	2.419	2.792	2.176	3.530	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.67	10.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.30	0.08	108.25	108.31	108.23
LKTB	122.57	0.15	122.44	122.68	122.40

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	-3.40	-0.90	-3.04	-0.76	-1.18	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-4.85	-0.25	-4.75	-3.10	-4.00	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-4.70	0.50	-4.90	-3.97	-5.75	-2.00	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-2.50	-0.30	-2.38	-3.34	-5.41	-2.20	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-13.45	0.80	-13.77	-11.77	-12.71	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-14.50	0.00	-14.50	-14.43	-19.15	-13.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.95	-0.35	-21.81	-22.04	-27.31	-20.85	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-22.75	-1.00	-22.35	-22.46	-29.30	-20.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-14.25	1.50	-14.85	-11.65	-19.45	-7.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1115.30 (-5.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-49.50	2.00	1Y	1.3500	1.00	1.6200	0.8050	1*2Y	-6.50	0.00		
-58.75	2.25	1.5Y	1.3100	1.00	1.6600	0.8600	2*3Y	-0.50	0.00		
-65.00	2.50	2Y	1.2850	1.00	1.6950	0.9250	2*5Y	6.00	0.00		
-71.00	3.50	3Y	1.2800	1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	2.00	0.00		
-73.75	3.50	4Y	1.3000	1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	6.50	0.00		
-72.50	3.50	5Y	1.3450	1.00	1.8500	1.0800	4*5Y	4.50	0.00		
-72.75	3.75	7Y	1.3850	1.00	1.8950	1.1050	5*7Y	4.00	0.00		
-60.25	4.00	10Y	1.5800	1.00	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	2.8307	-0.0120	2.8427	2.8253	2.8041	2.8427	1.2458	2.8427	0.3100
10Y	3.0474	-0.0484	3.0958	3.0874	3.0650	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	84.87	0.8	84.07	84.33	82.21	88.61	-53.43	88.61	-239.70
10Y	63.74	-2.84	66.58	67.74	65.50	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	24.75	-1.50	26.25	24.75	24.75	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	42.80	0.00	42.80	42.80	42.80	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	21.67	-3.64	25.31	26.21	26.09	105.74	18.51	221.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	94	SPRD	3*5Y 08						
03Y	0.25 / 99.25		10*12Y 04						
04Y	04 / 3.75								
05Y	08 / 07 / 7.5 / 8.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	165 건	-28	193	0	165	193	161	86	
금 액	46,257 억원	-19,220	65,477	0,000	46,257	65,477	68,695	22,450	

장중동향
국고채 금리, 전일 금리 상승을 되돌리며 금리 하락 마감. FOMC 대기 모드.

IRS, 전반적 금리 하락. 커브 플랫닝.
글로벌 금리가 올랐지만 개인이 국채선물을 매수한 데 영향을 받아 등락을 거듭.

CRS, 금리 상승 마감.