IPS Daily Morning Brief

2018-09-07

종가 기준일 2018-09-06

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7325	0.25	1.7325	1.7285	1.7232	1.7575	1.3900	2.6550	1.2875
9M	1.7650	0.25	1.7685	1.7740	1.7810	1.8300	1.4100	2.6675	1.2500
1Y	1.7825	0.25	1.7870	1.7993	1.8199	1.9100	1.4350	2.6800	1.2200
1.5Y	1.8200	0.50	1.8240	1.8460	1.8855	2.0250	1.4700	2.7300	1.1900
2Y	1.8400	0.50	1.8455	1.8763	1.9338	2.1150	1.5000	2.7800	1.1675
3Y	1.8800	0.50	1.8855	1.9209	1.9960	2.2225	1.5550	2.8650	1.1550
4Y	1.9175	0.50	1.9235	1.9606	2.0431	2.2950	1.6050	2.9400	1.1575
5Y	1.9450	0.50	1.9555	1.9948	2.0798	2.3400	1.6475	2.9975	1.1575
7Y	1.9900	0.75	1.9995	2.0380	2.1215	2.3950	1.7050	3.0975	1.1675
10Y	2.0525	1.50	2.0630	2.1006	2.1850	2.4850	1.7825	3.2075	1.2125
12Y	2.0925	1.75	2.1005	2.1381	2.2240	2.5225	1.8175	3.2525	1.2150
15Y	2.1050	1.75	2.1120	2.1523	2.2460	2.5400	1.8250	3.2900	1.2150
20Y	2.1125	1.50	2.1215	2.1594	2.2643	2.5600	1.8250	3.4100	1.2150
6*9M	3.25	0.00	3.60	4.55	5.78	12.50	1.75	12.50	-6.00
9*12M	1.75	0.00	1.85	2.53	3.89	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	5.75	0.25	5.85	7.70	11.38	23.00	5.50	23.00	-5.50
2*3Y	4.00	0.00	4.00	4.46	6.23	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.75	0.00	7.80	8.44	10.93	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	10.50	0.00	11.00	11.85	14.60	27.25	10.50	34.00	-1.75
3*4Y	3.75	0.00	3.80	3.98	4.70	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	6.50	0.00	7.00	7.39	8.37	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	2.75	0.00	3.20	3.41	3.67	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.50	0.25	4.40	4.33	4.18	8.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.75	1.00	10.75	10.59	10.53	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.75	6.35	6.26	6.35	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.25	3.75	3.75	3.90	4.50	2.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.25	4.90	5.16	6.10	6.75	2.50	15.00	-0.75
10*20Y	6.00	0.00	5.85	5.88	7.92	10.25	3.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.761	0.40	1.765	1.803	1.837	1.935	1.400	2.673	1.237
1.5Y	1.831	0.50	1.835	1.878	1.937	2.113	1.517	2.725	1.232
2Y	1.870	1.30	1.870	1.929	2.006	2.230	1.577	2.785	1.225
3Y	1.917	1.90	1.914	1.974	2.063	2.315	1.617	2.855	1.200
4Y	2.001	1.30	2.003	2.070	2.181	2.502	1.760	3.005	1.232
5Y	2.085	0.80	2.095	2.179	2.295	2.602	1.830	3.117	1.217
7Y	2.206	0.70	2.222	2.303	2.421	2.728	2.024	3.225	1.270
10Y	2.275	1.00	2.292	2.387	2.507	2.815	2.115	3.451	1.355
20Y	2.205	0.30	2.238	2.347	2.489	2.792	2.197	3.648	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.52	3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.93	-0.04	108.95	109.02	108.93
LKTB	124.21	-0.13	124.32	124.71	124.19

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	2.15	-0.15	2.18	-0.32	-1.67	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-1.10	0.00	-1.06	-3.24	-5.12	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-3.00	-0.80	-2.49	-5.30	-7.21	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-3.70	-1.40	-2.85	-5.32	-6.73	-2.25	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-8.35	-0.80	-7.95	-10.97	-13.79	-7.55	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-14.00	-0.30	-13.97	-18.41	-21.54	-13.45	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.60	0.05	-22.23	-26.45	-29.97	-21.60	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-22.25	0.50	-22.90	-28.68	-32.17	-22.20	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-9.25	1.20	-11.69	-18.78	-22.48	-9.25	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-52.25	-2.75
-57.50	-3.00
-60.00	-3.00
-63.00	-3.50
-64.75	-3.50
-63.50	-3.50
-65.00	-3.75
-52.75	-4.50

CRS

USD/KRW 1124.00 (+2.50)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2600	-2.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-2.00	0.00
1.5Y	1.2450	-2.50	1.6600	0.8600	2*3Y	1.00	-0.50
2Y	1.2400	-2.50	1.6950	0.9250	2*5Y	7.00	-0.50
3Y	1.2500	-3.00	1.7550	0.9850	3*4Y	2.00	0.00
4Y	1.2700	-3.00	1.8000	1.0700	3*5Y	6.00	0.00
5Y	1.3100	-3.00	1.8500	1.0800	4*5Y	4.00	0.00
7Y	1.3400	-3.00	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00
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	2.6371	-0.0203	2.6574	2.6574	2.6330	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.8780	-0.0205	2.8985	2.8985	2.8613	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	76.71	-3.33	80.04	77.74	75.80	80.04	-53.43	80.04	-245.00
10Y	60.30	-3.05	63.35	59.05	55.93	63.35	-24.46	63.35	-89.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	21.25	1.00	20.25	22.75	22.50	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	40.50	-0.30	40.80	42.80	42.70	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	24.09	-0.02	24.11	24.11	22.83	105.99	18.51	226.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6y 94
06M			
09M			
01Y	77.75		
1.5Y			
02Y	83.25 / 83.75 / 84	SPRD	1*2y 06
03Y			1.5*4y 10.25
04Y			10*12y 04
05Y			
07Y			
10Y	5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	132 건	30	102	152	67	146	149	133
금 액	38,813 억원	12,003	26,810	62,618	20,740	63,450	49,280	39,684

장중동향

채권 금리상승.
오전중 보합권에 머물던 채권은 강세전환했다가 부담감으로 되돌림 하락마감.

IRS도 레벨상승 커브 스팁마감.
장중 국채선물과 연동해 변동성이 큰 장세. 역외의 비드가 계속되며 장기물의 약세가 계속됨.

CRS 전테너 하락 마감.