IPS Daily Morning Brief

2018-08-07

종가 기준일 2018-08-06

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7350	-0.25	1.7450	1.7258	1.7194	1.7575	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7900	-0.25	1.8005	1.7850	1.7874	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8375	-0.50	1.8500	1.8321	1.8394	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9075	-0.75	1.9255	1.9086	1.9239	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9600	-1.25	1.9840	1.9636	1.9905	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0275	-1.50	2.0505	2.0311	2.0734	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0850	-1.75	2.1055	2.0789	2.1310	2.2950	1.6050	3.0050	1.1575
5Y	2.1350	-1.75	2.1475	2.1171	2.1724	2.3400	1.6475	3.0775	1.1575
7Y	2.1850	-2.00	2.1905	2.1555	2.2183	2.3950	1.7050	3.1900	1.1675
10Y	2.2500	-1.25	2.2495	2.2180	2.2849	2.4850	1.7825	3.3175	1.2125
12Y	2.2875	-1.50	2.2890	2.2579	2.3248	2.5225	1.8175	3.3575	1.2150
15Y	2.3100	-1.50	2.3115	2.2830	2.3509	2.5400	1.8250	3.3850	1.2150
20Y	2.3225	-1.75	2.3260	2.3020	2.3778	2.5600	1.8250	3.5050	1.2150

6*9M	5.50	0.00	5.55	5.93	6.80	12.50	1.00	12.50	-6.00
9*12M	4.75	-0.25	4.95	4.71	5.20	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	12.25	-0.75	13.40	13.15	15.10	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	6.75	-0.25	6.65	6.75	8.30	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	12.50	-0.50	12.15	11.53	14.05	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	17.50	-0.50	16.35	15.35	18.20	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.75	-0.25	5.50	4.78	5.76	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	10.75	-0.25	9.70	8.60	9.90	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	5.00	0.00	4.20	3.83	4.14	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	5.00	-0.25	4.30	3.84	4.58	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.50	0.50	10.20	10.09	11.25	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.75	5.90	6.25	6.66	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	-0.25	3.95	3.99	4.00	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	6.00	-0.25	6.20	6.50	6.60	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	7.25	-0.50	7.65	8.40	9.29	10.25	-2.50	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.870	-0.70	1.878	1.846	1.855	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.975	-1.70	1.993	1.952	1.986	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.025	-1.50	2.047	2.028	2.079	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.092	-1.00	2.109	2.092	2.153	2.315	1.617	2.888	1.200
4Y	2.202	-1.50	2.223	2.213	2.302	2.502	1.755	3.070	1.232
5Y	2.335	-2.00	2.356	2.336	2.414	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.465	-1.40	2.479	2.463	2.541	2.728	2.024	3.307	1.270
10Y	2.565	-1.00	2.573	2.553	2.632	2.815	2.115	3.561	1.355
20Y	2.552	-1.30	2.556	2.545	2.627	2.792	2.197	3.755	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.45	-4.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.17	0.04	108.14	108.17	108.09
LKTB	121.31	0.20	121.18	121.31	121.09

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	-3.25	0.20	-2.78	-1.42	-1.56	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-6.75	0.95	-6.79	-4.35	-6.20	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-6.50	0.25	-6.34	-6.44	-8.88	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-6.45	-0.50	-5.87	-6.12	-7.92	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-11.70	-0.25	-11.77	-13.42	-17.07	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-20.00	0.25	-20.89	-21.90	-24.14	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-28.00	-0.60	-28.87	-30.73	-32.24	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-31.50	-0.25	-32.39	-33.49	-34.68	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-22.95	-0.45	-22.98	-24.26	-24.93	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-56.75	-2.50
-61.25	-0.25
-65.00	0.75
-66.75	1.50
-68.50	1.75
-67.00	1.75
-67.50	2.00
-55.00	1.25

CRS

USD/KRW 1124.00 (-3.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2700	-3.00	1.6200	0.8050	1*2Y	4.00	2.50
1.5Y	1.2950	-1.00	1.6600	0.8600	2*3Y	5.00	0.50
2Y	1.3100	-0.50	1.6950	0.9250	2*5Y	15.50	0.50
3Y	1.3600	0.00	1.7550	0.9850	3*4Y	4.00	0.00
4Y	1.4000	0.00	1.8000	1.0700	3*5Y	10.50	0.00
5Y	1.4650	0.00	1.8500	1.0800	4*5Y	6.50	0.00
7Y	1.5100	0.00	1.8950	1.1050	5*7Y	4.50	0.00
10Y	1.7000	0.00	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	2.6534	0.0001	2.6533	2.6655	2.6816	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.9437	-0.0064	2.9501	2.9864	3.0060	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	62.84	1.51	61.33	61.55	62.16	67.13	-53.43	67.13	-245.00
10Y	37.87	0.36	37.51	41.44	42.10	43.19	-24.46	47.40	-91.80

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	29.00	0.00	29.00	25.75	25.75	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	54.00	0.50	53.50	52.20	52.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	29.03	-0.65	29.68	32.09	32.44	122.70	23.86	233.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	
06M	73.75		
09M	79.25		
01Y			
1.5Y			
02Y	97 / 97.25	SPRD	3*4y 06
03Y	4		3*7y 16 / 16.5
04Y	10		3*10y 22 / 22.25
05Y	13.5		4*7y 10.5
07Y	20.25		5*7y 5.25
10Y	26.25 / 26.5		5*10y 12
12Y			10*20y 7.5
15Y			12*20y 3.5
20Y			
CRS	1.5y 28.5 / 2y 28, 29		

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	90 건	-20	110	81	110	61	76	106
금 액	19,772 억원	-13,465	33,237	22,350	30,610	15,180	35,595	37,444

장중동향

채권 금리하락마감.

국내 채권은 무역분쟁으로 전일 미국금리가 상승한데다 중국 주가가 하락하면서 오후들어 강세폭을 키워 금리하락 마감. 외인 매수세 지속.

IRS 금리도 전구간 하락.

역외의 매수와 장기물 강세로 레벨 하락하면서 커브 플래트닝. 아웃라인 거래도 있었지만 7년, 10년 관련 스프레드 거래가 활발.

CRS는 1년~2년까지 구간만 하락하고 그 이후 테너는 전일비 유지.