IPS Daily Morning Brief

2018-08-09

종가 기준일 2018-08-08

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7325	-0.25	1.7370	1.7294	1.7192	1.7575	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7875	-0.25	1.7920	1.7876	1.7863	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8275	-1.00	1.8390	1.8353	1.8371	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8950	-1.00	1.9100	1.9118	1.9200	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9450	-1.00	1.9645	1.9668	1.9853	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0125	-1.00	2.0320	2.0338	2.0670	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0650	-1.00	2.0875	2.0821	2.1242	2.2950	1.6050	3.0050	1.1575
5Y	2.1100	-1.00	2.1330	2.1215	2.1655	2.3400	1.6475	3.0775	1.1575
7Y	2.1625	-0.75	2.1825	2.1609	2.2115	2.3950	1.7050	3.1825	1.1675
10Y	2.2325	-0.75	2.2465	2.2239	2.2783	2.4850	1.7825	3.2975	1.2125
12Y	2.2700	-0.75	2.2850	2.2635	2.3181	2.5225	1.8175	3.3400	1.2150
15Y	2.2925	-0.75	2.3075	2.2881	2.3442	2.5400	1.8250	3.3750	1.2150
20Y	2.3050	-0.75	2.3210	2.3054	2.3707	2.5600	1.8250	3.4950	1.2150

6*9M	5.50	0.00	5.50	5.83	6.71	12.50	1.00	12.50	-6.00
9*12M	4.00	-0.75	4.70	4.76	5.08	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	11.75	0.00	12.55	13.15	14.82	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	6.75	0.00	6.75	6.70	8.18	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	12.00	0.00	12.30	11.54	13.89	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	16.50	0.00	16.85	15.48	18.03	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.25	0.00	5.55	4.84	5.71	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	9.75	0.00	10.10	8.78	9.85	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.55	3.94	4.14	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	5.25	0.25	4.95	3.94	4.59	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	12.25	0.25	11.35	10.24	11.27	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.00	6.40	6.30	6.68	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.85	3.96	3.99	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	6.00	0.00	6.10	6.42	6.60	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	7.25	0.00	7.45	8.15	9.25	10.25	-2.50	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.843	-1.10	1.865	1.850	1.853	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.945	-1.60	1.976	1.957	1.981	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.000	-1.50	2.026	2.030	2.073	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.067	-1.50	2.091	2.093	2.145	2.315	1.617	2.888	1.200
4Y	2.182	-1.00	2.204	2.212	2.292	2.502	1.755	3.070	1.232
5Y	2.317	-0.80	2.338	2.337	2.405	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.450	-0.50	2.466	2.464	2.533	2.728	2.024	3.307	1.270
10Y	2.555	-0.20	2.565	2.556	2.624	2.815	2.115	3.561	1.355
20Y	2.530	-1.20	2.549	2.545	2.619	2.792	2.197	3.745	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.49	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.24	0.04	108.18	108.24	108.16
LKTB	121.31	0.01	121.24	121.35	121.16

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	-1.55	0.10	-2.62	-1.50	-1.63	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-5.00	0.60	-6.56	-4.51	-6.13	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-5.50	0.50	-6.15	-6.28	-8.77	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-5.45	0.50	-5.86	-5.91	-7.83	-2.45	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-11.70	0.00	-11.61	-12.99	-16.81	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-20.70	-0.20	-20.54	-21.52	-23.98	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-28.75	-0.25	-28.33	-30.27	-32.11	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-32.25	-0.55	-31.83	-33.18	-34.53	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-22.50	0.45	-22.82	-24.00	-24.82	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-54.75	2.00
-59.50	2.00
-62.50	2.00
-62.75	2.50
-64.50	2.00
-63.00	1.50
-63.75	1.25
-51.75	1.25

CRS

USD/KRW 1119.90 (-3.90)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2800	1.00	1.6200	0.8050	1*2Y	4.00	0.00
1.5Y	1.3000	1.00	1.6600	0.8600	2*3Y	6.50	0.50
2Y	1.3200	1.00	1.6950	0.9250	2*5Y	16.00	-0.50
3Y	1.3850	1.50	1.7550	0.9850	3*4Y	3.50	-0.50
4Y	1.4200	1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	9.50	-1.00
5Y	1.4800	0.50	1.8500	1.0800	4*5Y	6.00	-0.50
7Y	1.5250	0.50	1.8950	1.1050	5*7Y	4.50	0.00
10Y	1.7150	0.50	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	2.6697	0.0082	2.6615	2.6534	2.6533	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.9623	-0.0093	2.9716	2.9437	2.9501	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	66.97	2.32	64.65	62.84	61.33	67.13	-53.43	67.13	-245.00
10Y	40.73	-0.73	41.46	37.87	37.51	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	28.75	0.25	28.50	29.00	29.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	55.50	1.30	54.20	54.00	53.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	29.26	-1.75	31.01	29.03	29.68	122.00	23.86	233.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	
06M	73.25		
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y		SPRD	3*5Y 9.75
03Y	2.25		2*10Y 29
04Y			
05Y	11		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1Y CCS 28 / 28.5 1.5Y CCS 30.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	93 건	23	70	90	110	81	110	61
금 액	42,150 억원	24,880	17,270	19,772	33,237	22,350	30,610	15,180

장중동향

국고채 금리, 하락 마감.
3년물은 약보합세로 출발해 오전장 후반 보합세로 회복했음. 이후 소폭 상승해 강보합세로 마감

IRS 금리, 하락마감.
채권 단기물의 수급이 워낙 좋고 강세가 이어져 IRS도 오퍼 우위. 특히 국채선물 흐름과 별개로 7년 이하 구간에서 오퍼가 강함.

CRS 금리, 전 구간 상승마감.
3년 이하 구간에서 로컬오퍼와 포린비드로 거래.