IPS Daily Morning Brief

2018-08-21

종가 기준일 2018-08-20

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7225	-0.50	1.7330	1.7379	1.7215	1.7575	1.3900	2.6600	1.2875
9M	1.7675	-0.50	1.7790	1.7893	1.7854	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.7900	-0.50	1.8050	1.8294	1.8313	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8350	-0.75	1.8600	1.8979	1.9078	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.8700	-0.50	1.8945	1.9459	1.9666	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	1.9100	-1.50	1.9470	2.0079	2.0417	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	1.9475	-1.25	1.9895	2.0571	2.0957	2.2950	1.6050	3.0050	1.1575
5Y	1.9825	-1.50	2.0245	2.0964	2.1358	2.3400	1.6475	3.0775	1.1575
7Y	2.0225	-1.25	2.0660	2.1391	2.1797	2.3950	1.7050	3.1825	1.1675
10Y	2.0875	-1.75	2.1285	2.2013	2.2447	2.4850	1.7825	3.2975	1.2125
12Y	2.1250	-1.75	2.1660	2.2399	2.2843	2.5225	1.8175	3.3400	1.2150
15Y	2.1400	-1.75	2.1810	2.2604	2.3092	2.5400	1.8250	3.3750	1.2150
20Y	2.1425	-1.75	2.1835	2.2705	2.3319	2.5600	1.8250	3.4950	1.2150
6*9M	4.50	0.00	4.60	5.14	6.39	12.50	1.00	12.50	-6.00
9*12M	2.25	0.00	2.60	4.01	4.60	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	8.00	0.00	8.95	11.65	13.53	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	4.00	-1.00	5.25	6.20	7.51	13.25	4.00	13.25	-1.75
2*4Y	7.75	-0.75	9.50	11.13	12.91	21.75	7.75	23.50	-1.75
2*5Y	11.25	-1.00	13.00	15.05	16.92	27.25	11.25	34.00	-1.75
3*4Y	3.75	0.25	4.25	4.93	5.40	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.25	0.00	7.75	8.85	9.41	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	-0.25	3.50	3.93	4.01	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.25	4.15	4.28	4.39	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.50	-0.25	10.40	10.49	10.89	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	-0.50	6.25	6.21	6.50	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.86	3.95	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.25	5.91	6.45	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	5.50	0.00	5.50	6.93	8.72	10.25	1.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.819	-0.90	1.834	1.850	1.851	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.902	-1.00	1.928	1.953	1.970	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	1.957	-0.80	1.986	2.016	2.054	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	1.982	-0.80	2.026	2.072	2.120	2.315	1.617	2.885	1.200
4Y	2.069	-1.60	2.124	2.183	2.256	2.502	1.755	3.067	1.232
5Y	2.180	-2.00	2.241	2.308	2.371	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.306	-2.00	2.362	2.433	2.498	2.728	2.024	3.307	1.270
10Y	2.405	-2.20	2.459	2.529	2.587	2.815	2.115	3.561	1.355
20Y	2.382	-1.30	2.423	2.506	2.577	2.792	2.197	3.745	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.50	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.62	0.07	108.55	108.62	108.51
LKTB	122.82	0.22	122.55	122.88	122.47

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	-2.90	0.40	-2.92	-2.02	-1.99	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-6.70	0.25	-6.80	-5.47	-6.19	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-8.70	0.30	-9.19	-7.03	-8.71	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-7.20	-0.70	-7.88	-6.40	-7.82	-2.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-12.15	0.35	-13.47	-12.54	-16.06	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-19.75	0.50	-21.63	-21.17	-23.56	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-28.35	0.75	-29.56	-29.36	-31.80	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-31.75	0.45	-33.03	-32.82	-34.26	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-23.95	-0.45	-23.99	-23.54	-24.55	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-56.50	-1.00
-61.00	-1.25
-65.00	-1.50
-64.50	-0.50
-65.25	-0.75
-63.75	-0.50
-64.25	-0.75
-51.75	-0.25

CRS

USD/KRW 1123.10 (-1.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2250	-1.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-0.50	-0.50
1.5Y	1.2250	-2.00	1.6600	0.8600	2*3Y	4.50	0.00
2Y	1.2200	-2.00	1.6950	0.9250	2*5Y	12.50	0.00
3Y	1.2650	-2.00	1.7550	0.9850	3*4Y	3.00	0.00
4Y	1.2950	-2.00	1.8000	1.0700	3*5Y	8.00	0.00
5Y	1.3450	-2.00	1.8500	1.0800	4*5Y	5.00	0.00
7Y	1.3800	-2.00	1.8950	1.1050	5*7Y	3.50	0.00
10Y	1.5700	-2.00	2.0500	1.2200	5*10Y	22.50	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	2.5831	-0.0290	2.6121	2.6246	2.6123	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.8145	-0.0451	2.8596	2.8650	2.8614	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	62.61	-2.1	64.71	62.46	60.23	67.13	-53.43	67.13	-245.00
10Y	40.95	-2.31	43.26	39.50	36.64	43.26	-24.46	47.40	-89.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	21.75	-1.25	23.00	23.75	24.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	44.80	-1.40	46.20	47.00	48.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	23.14	-1.61	24.75	24.04	24.91	116.00	23.14	233.00	23.14

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	85		
02Y	87.75	SPRD	6*9m 4.5
03Y			9*12m 2.25
04Y	96 / 96.5		
05Y	0.25		6*9*12m fly 2.25
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y CCS 23 / 4y CCS 31		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	93 건	-47	140	141	80	86	86	112
금 액	25,285 억원	-26,800	52,085	66,420	27,100	27,780	27,780	33,740

장중동향

채권금리 하락마감.
고용부진의 여파로 시장은 꾸준한 강세를 보임. 오후들어 채권은 더욱 강해지며 강세 마감.

IRS도 레벨하락, 커브 플랫마감.
장 후반 선물이 강세를 보이자 오퍼가 우위를 보이며 하락.

CRS는 롤오버 에셋물량 우위로 전구간 레벨 하락.