

IPS Daily Morning Brief

2018-08-06

종가 기준일 2018-08-03

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7375	-0.75	1.7495	1.7240	1.7195	1.7575	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7925	-0.75	1.8055	1.7838	1.7880	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8425	-0.75	1.8555	1.8305	1.8405	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9150	-1.25	1.9330	1.9070	1.9258	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9725	-1.75	1.9930	1.9621	1.9929	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0425	-1.25	2.0590	2.0300	2.0765	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.1025	-0.75	2.1120	2.0773	2.1342	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.1525	0.50	2.1510	2.1149	2.1755	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.2050	1.50	2.1910	2.1529	2.2212	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2625	1.50	2.2485	2.2154	2.2878	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.3025	1.50	2.2885	2.2554	2.3278	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.3250	1.50	2.3115	2.2808	2.3538	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3400	1.50	2.3265	2.3006	2.3808	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150

6*9M	5.50	0.00	5.60	5.98	6.85	12.50	1.00	12.50	-6.00
9*12M	5.00	0.00	5.00	4.68	5.26	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	13.00	-1.00	13.75	13.16	15.24	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	7.00	0.50	6.60	6.79	8.36	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	13.00	1.00	11.90	11.51	14.13	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	18.00	2.25	15.80	15.28	18.25	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	6.00	0.50	5.30	4.73	5.77	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	11.00	1.75	9.20	8.49	9.90	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	5.00	1.25	3.90	3.76	4.13	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	5.25	1.00	4.00	3.80	4.58	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.00	1.00	9.75	10.05	11.23	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	5.75	0.00	5.75	6.25	6.66	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.00	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.25	0.00	6.30	6.54	6.60	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	7.75	0.00	7.80	8.53	9.30	10.25	-2.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.877	-0.50	1.879	1.844	1.856	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.992	-1.30	1.995	1.950	1.988	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.040	-1.00	2.054	2.028	2.082	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.102	-0.80	2.116	2.093	2.156	2.315	1.617	2.888	1.200
4Y	2.217	-0.80	2.232	2.215	2.306	2.502	1.755	3.085	1.232
5Y	2.355	-0.50	2.363	2.337	2.418	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.479	-0.10	2.483	2.463	2.544	2.728	2.024	3.317	1.270
10Y	2.575	0.30	2.575	2.553	2.635	2.815	2.115	3.561	1.355
20Y	2.565	0.80	2.556	2.545	2.631	2.792	2.197	3.780	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.13	0.04	108.08	108.13	108.04
LKTb	121.11	-0.02	121.05	121.12	120.93

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-3.45	-0.25	-2.33	-1.34	-1.52	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.70	0.05	-6.16	-4.27	-6.23	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-6.75	-0.75	-6.14	-6.56	-8.94	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-5.95	-0.45	-5.72	-6.30	-7.96	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-11.45	0.05	-11.96	-13.74	-17.21	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-20.25	1.00	-21.18	-22.23	-24.25	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-27.40	1.60	-29.16	-31.06	-32.32	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-31.25	1.20	-32.61	-33.71	-34.76	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-22.50	0.70	-22.93	-24.41	-24.98	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1127.60 (+1.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-54.25	-0.25	1Y	1.3000	-1.00	1.6200	0.8050	1*2Y	1.50	-1.50		
-61.00	-1.25	1.5Y	1.3050	-2.50	1.6600	0.8600	2*3Y	4.50	0.00		
-65.75	-0.75	2Y	1.3150	-2.50	1.6950	0.9250	2*5Y	15.00	-0.50		
-68.25	-1.25	3Y	1.3600	-2.50	1.7550	0.9850	3*4Y	4.00	-0.50		
-70.25	-2.25	4Y	1.4000	-3.00	1.8000	1.0700	3*5Y	10.50	-0.50		
-68.75	-3.50	5Y	1.4650	-3.00	1.8500	1.0800	4*5Y	6.50	0.00		
-69.50	-4.50	7Y	1.5100	-3.00	1.8950	1.1050	5*7Y	4.50	0.00		
-56.25	-4.50	10Y	1.7000	-3.00	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	2.6533	-0.0122	2.6655	2.6816	2.6856	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.9501	-0.0363	2.9864	3.0060	2.9631	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	61.33	-0.22	61.55	62.16	62.36	67.13	-53.43	67.13	-245.00
10Y	37.51	-3.93	41.44	42.10	39.31	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	3.25	25.75	25.75	23.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	53.50	1.30	52.20	52.50	50.80	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	29.68	-2.41	32.09	32.44	27.75	122.70	23.86	236.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor	9Y 24.5					
06M									
09M	80								
01Y	84.75 / 85								
1.5Y									
02Y	98.75		SPRD	3*10Y 21					
03Y	5.25 / 4.25			1*2Y 13					
04Y				4*9Y 13.5					
05Y	15.5 / 15.25								
07Y									
10Y	26								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y CCS 35.5 / 32								
	3y CCS 40								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	110 건	29	81	110	61	76	106	82	
금 액	33,237 억원	10,887	22,350	30,610	15,180	35,595	37,444	20,877	

장중동향
국고채 금리, 혼조세.
국채선물은 보험세로 출발. 3년 국채선물은 강보험세에 머물다가 오전 11시경 약보험세로 반락. 오후 3시 전후로 반등에 성공해 강보험 마감.

IRS 금리, 4년 이하 구간은 하락 5년 이상 구간은 상승 마감. 커브 스티프닝.
3년 이하 단기구간은 오피 수요가 많았고, 장기 구간을 중심으로 외국계 기관의 비드 수요가 많았음.

IRS 금리, 하락마감.