

IPS Daily Morning Brief

2018-08-10

종가 기준일 2018-08-09

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7300	-0.25	1.7340	1.7303	1.7193	1.7575	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7800	-0.75	1.7880	1.7874	1.7859	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8150	-1.25	1.8320	1.8343	1.8360	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8800	-1.50	1.9005	1.9103	1.9181	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9250	-2.00	1.9515	1.9650	1.9828	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	1.9850	-2.75	2.0180	2.0316	2.0638	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0375	-2.75	2.0730	2.0806	2.1205	2.2950	1.6050	3.0050	1.1575
5Y	2.0750	-3.50	2.1185	2.1203	2.1618	2.3400	1.6475	3.0775	1.1575
7Y	2.1250	-3.75	2.1695	2.1604	2.2076	2.3950	1.7050	3.1825	1.1675
10Y	2.1950	-3.75	2.2360	2.2236	2.2743	2.4850	1.7825	3.2975	1.2125
12Y	2.2325	-3.75	2.2740	2.2631	2.3141	2.5225	1.8175	3.3400	1.2150
15Y	2.2550	-3.75	2.2965	2.2875	2.3402	2.5400	1.8250	3.3750	1.2150
20Y	2.2675	-3.75	2.3095	2.3039	2.3665	2.5600	1.8250	3.4950	1.2150

6*9M	5.00	-0.50	5.40	5.71	6.66	12.50	1.00	12.50	-6.00
9*12M	3.50	-0.50	4.40	4.69	5.01	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	11.00	-0.75	11.95	13.08	14.67	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	6.00	-0.75	6.65	6.66	8.10	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	11.25	-0.75	12.15	11.56	13.78	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	15.00	-1.50	16.70	15.53	17.90	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.25	0.00	5.50	4.90	5.68	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	9.00	-0.75	10.05	8.86	9.80	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.75	-0.75	4.55	3.96	4.13	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	5.00	-0.25	5.10	4.01	4.58	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	12.00	-0.25	11.75	10.34	11.25	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.00	6.65	6.33	6.67	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.80	3.95	3.98	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	6.00	0.00	6.05	6.39	6.59	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	7.25	0.00	7.35	8.03	9.22	10.25	-2.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.837	-0.60	1.856	1.850	1.853	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.935	-1.00	1.962	1.956	1.979	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	1.995	-0.50	2.015	2.028	2.070	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.055	-1.20	2.080	2.091	2.142	2.315	1.617	2.888	1.200
4Y	2.161	-2.10	2.191	2.209	2.287	2.502	1.755	3.070	1.232
5Y	2.287	-3.00	2.324	2.335	2.401	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.415	-3.50	2.453	2.461	2.528	2.728	2.024	3.307	1.270
10Y	2.517	-3.80	2.554	2.554	2.619	2.815	2.115	3.561	1.355
20Y	2.485	-4.50	2.535	2.543	2.614	2.792	2.197	3.745	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.32	0.08	108.26	108.32	108.24
LKTb	121.70	0.39	121.40	121.70	121.35

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-2.20	-0.65	-2.42	-1.53	-1.69	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-5.50	-0.50	-6.11	-4.61	-6.13	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-7.00	-1.50	-6.35	-6.28	-8.74	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-7.00	-1.55	-6.16	-5.95	-7.81	-2.45	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-12.35	-0.65	-11.78	-12.87	-16.70	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-21.20	-0.50	-20.53	-21.43	-23.92	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.00	-0.25	-28.33	-30.09	-32.05	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-32.20	0.05	-31.78	-33.05	-34.47	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-21.75	0.75	-22.53	-23.90	-24.74	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1117.20 (-2.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-56.00	-1.25	1Y	1.2550	-2.50	1.6200	0.8050	1*2Y	4.50	0.50	
-60.00	-0.50	1.5Y	1.2800	-2.00	1.6600	0.8600	2*3Y	6.00	-0.50	
-62.50	0.00	2Y	1.3000	-2.00	1.6950	0.9250	2*5Y	16.00	0.00	
-62.50	0.25	3Y	1.3600	-2.50	1.7550	0.9850	3*4Y	4.00	0.50	
-63.75	0.75	4Y	1.4000	-2.00	1.8000	1.0700	3*5Y	10.00	0.50	
-61.50	1.50	5Y	1.4600	-2.00	1.8500	1.0800	4*5Y	6.00	0.00	
-62.00	1.75	7Y	1.5050	-2.00	1.8950	1.1050	5*7Y	4.50	0.00	
-50.00	1.75	10Y	1.6950	-2.00	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	2.6493	-0.0204	2.6697	2.6615	2.6534	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.9276	-0.0347	2.9623	2.9716	2.9437	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	65.43	-1.54	66.97	64.65	62.84	67.13	-53.43	67.13	-245.00
10Y	41.06	0.33	40.73	41.46	37.87	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	27.00	-1.75	28.75	28.50	29.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	52.20	-3.30	55.50	54.20	54.00	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	27.83	-1.43	29.26	31.01	29.03	121.00	23.86	233.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS		ODD Tenor	8y 16.75							
06M										
09M	78.25									
01Y	81.5 / 82									
1.5Y	88 / 88.25 / 89									
02Y	92.25 / 93.25 / 93.5		SPRD	1*2y 11						
03Y	99 / 99.5 / 99.75 / 0			1.5*2y 6.75						
04Y	3.5 / 3.75 / 4.75 / 5			1.5*3y 11						
05Y	7.5 / 8.25 / 8.5			2*4y 11.25						
07Y		3*5y 8.75 / 9								
10Y	19 / 21.25	5*10y 11.5								
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	1y 26.5 / 2y 30 / 3y 39.5									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6		
거래현황	115 건	22	93	70	90	110	81	110		
금 액	26,086 억원	-16,064	42,150	17,270	19,772	33,237	22,350	30,610		

장중동향
 채권 금리하락, 컷브 플랫트닝.
 강제 출발한 채권은 계속 이어지는 무역분쟁 이슈와 외국인의 매수로 점점 강해져 고가로 마감.

IRS도 국채선물의 강세에 연동되어 하락하면서 플랫 마감. 주로 중단기쪽 아웃라잇거래가 주를 이뤘고, 컷브가 플랫되면서 스프레드 거래 활발.

CRS는 예셋 영향으로 오퍼우위를 보이며 전테너 하락 마감.