IPS Daily Morning Brief

2018-08-16

종가 기준일 2018-08-15

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7400	0.25	1.7365	1.7363	1.7203	1.7575	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7875	0.50	1.7830	1.7888	1.7855	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8175	0.25	1.8155	1.8320	1.8335	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8800	0.25	1.8780	1.9050	1.9125	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9150	0.25	1.9150	1.9561	1.9736	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	1.9725	0.25	1.9730	2.0205	2.0513	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0200	0.25	2.0215	2.0705	2.1068	2.2950	1.6050	3.0050	1.1575
5Y	2.0550	0.25	2.0570	2.1104	2.1474	2.3400	1.6475	3.0775	1.1575
7Y	2.1000	0.25	2.1030	2.1528	2.1923	2.3950	1.7050	3.1825	1.1675
10Y	2.1575	0.25	2.1635	2.2144	2.2578	2.4850	1.7825	3.2975	1.2125
12Y	2.1950	0.25	2.2010	2.2534	2.2975	2.5225	1.8175	3.3400	1.2150
15Y	2.2100	0.25	2.2175	2.2754	2.3229	2.5400	1.8250	3.3750	1.2150
20Y	2.2125	0.25	2.2220	2.2874	2.3470	2.5600	1.8250	3.4950	1.2150
6*9M	4.75	0.25	4.65	5.25	6.52	12.50	1.00	12.50	-6.00
9*12M	3.00	-0.25	3.25	4.32	4.80	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	9.75	0.00	9.95	12.41	14.01	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	5.75	0.00	5.80	6.44	7.78	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	10.50	0.00	10.65	11.44	13.32	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	14.00	0.00	14.20	15.43	17.38	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.75	0.00	4.85	5.00	5.54	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.25	0.00	8.40	8.99	9.60	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.55	3.99	4.06	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.50	0.00	4.60	4.24	4.49	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.25	0.00	10.65	10.40	11.04	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	5.75	0.00	6.05	6.16	6.55	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.90	3.97	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.40	6.10	6.51	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	5.50	0.00	5.85	7.30	8.92	10.25	0.50	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.844	0.50	1.839	1.849	1.852	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.947	0.80	1.938	1.955	1.974	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.010	1.00	1.999	2.022	2.061	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.060	0.80	2.052	2.083	2.130	2.315	1.617	2.888	1.200
4Y	2.165	1.00	2.156	2.197	2.270	2.502	1.755	3.070	1.232
5Y	2.285	0.80	2.278	2.324	2.385	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.400	0.00	2.402	2.449	2.512	2.728	2.024	3.307	1.270
10Y	2.495	-0.20	2.500	2.544	2.602	2.815	2.115	3.561	1.355
20Y	2.457	-0.50	2.465	2.527	2.594	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	-0.01	108.34	108.37	108.29
LKTB	121.89	0.02	121.84	122.03	121.79

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	-2.65	-0.25	-2.37	-1.69	-1.89	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-6.70	-0.55	-6.02	-4.99	-6.11	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-9.50	-0.75	-8.40	-6.59	-8.70	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-8.75	-0.55	-7.88	-6.26	-7.82	-2.45	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-14.50	-0.75	-13.47	-12.69	-16.36	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-23.00	-0.55	-22.12	-21.36	-23.76	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-30.00	0.25	-29.88	-29.65	-31.93	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-33.75	0.45	-33.69	-33.01	-34.39	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.45	0.75	-24.32	-23.93	-24.66	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-56.75	2.25
-63.00	2.25
-66.50	2.25
-66.75	2.75
-68.00	2.75
-66.00	2.25
-66.00	2.25
-52.75	2.25

CRS

USD/KRW 1127.90 (-6.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2500	2.50	1.6200	0.8050	1*2Y	0.00	0.00
1.5Y	1.2500	2.50	1.6600	0.8600	2*3Y	5.50	0.50
2Y	1.2500	2.50	1.6950	0.9250	2*5Y	14.50	0.00
3Y	1.3050	3.00	1.7550	0.9850	3*4Y	3.50	0.00
4Y	1.3400	3.00	1.8000	1.0700	3*5Y	9.00	-0.50
5Y	1.3950	2.50	1.8500	1.0800	4*5Y	5.50	-0.50
7Y	1.4400	2.50	1.8950	1.1050	5*7Y	4.50	0.00
10Y	1.6300	2.50	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	2.6123	-0.0288	2.6411	2.6124	2.6042	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.8614	-0.0390	2.9004	2.8813	2.8723	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	60.23	-3.88	64.11	61.24	61.42	67.13	-53.43	67.13	-245.00
10Y	36.64	-3.70	40.34	38.43	37.63	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	24.25	0.00	24.25	24.25	24.50	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	48.50	-1.20	49.70	49.70	50.60	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	24.91	-1.02	25.93	26.89	26.81	116.80	23.86	233.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	81.5		
1.5Y			
02Y	91 / 91.25	SPRD	1.5*2y 3.75
03Y			5*10y 10.5
04Y	1.75		
05Y			
07Y			
10Y	15.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2y 23, 23.5 / 4y 33		

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	80 건	-6	86	86	112	115	93	70
금 액	27,100 억원	-680	27,780	27,780	33,740	26,086	42,150	17,270

장중동향

채권 금리 보합권 마감.

채권은 터키이슈에 주목하며 보합권에서 맴돌았고, 장기물은 여전히 소폭 강세.

IRS는 소폭 상승.

전체적으로 0.25~0.5bp 상승. 광복절 휴일은 맞아 한산한 분위기에서 간간히 거래.

CRS는 비드 우위를 보이며 전구간 상승.