IPS Daily Morning Brief

2018-08-20

종가 기준일 2018-08-17

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7275	-1.00	1.7360	1.7376	1.7212	1.7575	1.3900	2.6600	1.2875
9M	1.7725	-1.25	1.7820	1.7894	1.7855	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.7950	-1.25	1.8100	1.8306	1.8322	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8425	-2.25	1.8685	1.9009	1.9095	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.8750	-2.50	1.9030	1.9499	1.9691	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	1.9250	-3.25	1.9590	2.0131	2.0453	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	1.9600	-4.25	2.0035	2.0628	2.0998	2.2950	1.6050	3.0050	1.1575
5Y	1.9975	-3.75	2.0385	2.1023	2.1401	2.3400	1.6475	3.0775	1.1575
7Y	2.0350	-4.00	2.0810	2.1450	2.1843	2.3950	1.7050	3.1825	1.1675
10Y	2.1050	-3.25	2.1420	2.2070	2.2494	2.4850	1.7825	3.2975	1.2125
12Y	2.1425	-3.25	2.1795	2.2458	2.2890	2.5225	1.8175	3.3400	1.2150
15Y	2.1575	-3.25	2.1945	2.2668	2.3141	2.5400	1.8250	3.3750	1.2150
20Y	2.1600	-3.25	2.1970	2.2775	2.3373	2.5600	1.8250	3.4950	1.2150

6*9M	4.50	-0.25	4.60	5.18	6.43	12.50	1.00	12.50	-6.00
9*12M	2.25	0.00	2.80	4.13	4.66	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	8.00	-1.25	9.30	11.93	13.70	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	5.00	-0.75	5.60	6.33	7.61	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	8.50	-1.75	10.05	11.29	13.06	21.75	8.50	23.50	-1.75
2*5Y	12.25	-1.25	13.55	15.24	17.10	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	3.50	-1.00	4.45	4.96	5.45	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.25	-0.50	7.95	8.91	9.48	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.75	0.50	3.50	3.95	4.03	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.75	-0.25	4.25	4.28	4.42	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.75	0.50	10.35	10.48	10.93	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.75	6.10	6.20	6.51	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.88	3.96	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.25	5.98	6.47	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	5.50	0.00	5.50	7.05	8.78	10.25	1.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.828	-1.30	1.838	1.850	1.852	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.912	-2.80	1.935	1.954	1.971	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	1.965	-3.50	1.995	2.019	2.056	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	1.990	-5.50	2.040	2.077	2.124	2.315	1.617	2.885	1.200
4Y	2.085	-6.20	2.141	2.189	2.262	2.502	1.755	3.067	1.232
5Y	2.200	-6.20	2.260	2.315	2.377	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.326	-5.00	2.380	2.440	2.503	2.728	2.024	3.307	1.270
10Y	2.427	-4.30	2.477	2.536	2.593	2.815	2.115	3.561	1.355
20Y	2.395	-2.60	2.439	2.514	2.583	2.792	2.197	3.745	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.50	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.55	0.16	108.41	108.55	108.40
LKTB	122.60	0.44	122.20	122.61	122.16

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	-3.30	0.05	-2.82	-1.91	-1.98	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-6.95	0.55	-6.69	-5.31	-6.17	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-9.00	1.00	-9.20	-6.90	-8.72	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-6.50	2.25	-8.08	-6.35	-7.83	-2.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-12.50	1.95	-13.79	-12.62	-16.18	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-20.25	2.45	-22.17	-21.28	-23.65	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.10	1.00	-29.94	-29.49	-31.87	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-32.20	1.05	-33.52	-32.92	-34.32	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-23.50	-0.65	-24.24	-23.64	-24.58	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-55.50	0.75
-59.75	2.25
-63.50	2.00
-64.00	2.25
-64.50	3.25
-63.25	2.25
-63.50	1.50
-51.50	0.75

CRS

USD/KRW 1124.90 (-5.20)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2400	-0.50	1.6200	0.8050	1*2Y	0.00	0.00
1.5Y	1.2450	0.00	1.6600	0.8600	2*3Y	4.50	-0.50
2Y	1.2400	-0.50	1.6950	0.9250	2*5Y	12.50	-1.00
3Y	1.2850	-1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	3.00	0.00
4Y	1.3150	-1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	8.00	-0.50
5Y	1.3650	-1.50	1.8500	1.0800	4*5Y	5.00	-0.50
7Y	1.4000	-2.50	1.8950	1.1050	5*7Y	3.50	-1.00
10Y	1.5900	-2.50	2.0500	1.2200	5*10Y	22.50	-1.00

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	2.6121	-0.0125	2.6246	2.6123	2.6411	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.8596	-0.0054	2.8650	2.8614	2.9004	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	64.71	2.25	62.46	60.23	64.11	67.13	-53.43	67.13	-245.00
10Y	43.26	3.76	39.50	36.64	40.34	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	23.00	-0.75	23.75	24.25	24.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	46.20	-0.80	47.00	48.50	49.70	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	24.75	0.71	24.04	24.91	25.93	116.80	23.86	233.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6Y 4.5
06M			
09M	78		
01Y	80 / 80.5		
1.5Y	85 / 85.5		
02Y	89 / 88.5	SPRD	9*12M 2.25
03Y			4*10Y 13.75
04Y			
05Y	2.25 / 0.5		
07Y			
10Y	12.5 / 12.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	4y CCS 31		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	140 건	-1	141	80	86	86	112	115
금 액	52,085 억원	-14,335	66,420	27,100	27,780	27,780	33,740	26,086

장중동향

국고채 금리, 일제히 하락하며 대부분 연중 최저치 기록.
오전에 발표된 고용지표 금융위기 이후 최악의 수준을 보인 가운데 외인과 증권사가 3년 선물 순매수 폭을 키우면서 금리 하락 폭 증가.

IRS, 금리 전구간 하락 마감.
9M~2Y 구간을 중심으로 호가 대치 활발.
CRS, 1.5Y을 제외한 구간에서 금리 하락.
장중 오퍼가 계속 나왔지만 역외에서 비드가 나와 금리 제한적 하락.