

IPS Daily Morning Brief

2018-08-22

종가 기준일 2018-08-21

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7075	-1.50	1.7270	1.7369	1.7218	1.7575	1.3900	2.6600	1.2875
9M	1.7500	-1.75	1.7725	1.7878	1.7851	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.7725	-1.75	1.7965	1.8266	1.8305	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8150	-2.00	1.8475	1.8933	1.9060	2.0250	1.4700	2.7675	1.1900
2Y	1.8475	-2.25	1.8815	1.9401	1.9640	2.1150	1.5000	2.8225	1.1675
3Y	1.8825	-2.75	1.9295	2.0004	2.0382	2.2225	1.5550	2.9225	1.1550
4Y	1.9225	-2.50	1.9705	2.0491	2.0917	2.2950	1.6050	3.0050	1.1575
5Y	1.9575	-2.50	2.0055	2.0879	2.1315	2.3400	1.6475	3.0775	1.1575
7Y	2.0000	-2.25	2.0465	2.1306	2.1753	2.3950	1.7050	3.1825	1.1675
10Y	2.0675	-2.00	2.1110	2.1930	2.2403	2.4850	1.7825	3.2975	1.2125
12Y	2.1050	-2.00	2.1485	2.2315	2.2798	2.5225	1.8175	3.3400	1.2150
15Y	2.1225	-1.75	2.1640	2.2516	2.3046	2.5400	1.8250	3.3750	1.2150
20Y	2.1300	-1.25	2.1675	2.2614	2.3269	2.5600	1.8250	3.4950	1.2150

6*9M	4.25	-0.25	4.55	5.09	6.33	12.50	1.00	12.50	-6.00
9*12M	2.25	0.00	2.40	3.89	4.53	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	7.50	-0.50	8.50	11.35	13.36	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	3.50	-0.50	4.80	6.03	7.41	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.50	-0.25	8.90	10.90	12.76	21.75	7.50	23.50	-1.75
2*5Y	11.00	-0.25	12.40	14.78	16.75	27.25	11.00	34.00	-1.75
3*4Y	4.00	0.25	4.10	4.88	5.35	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.50	0.25	7.60	8.75	9.34	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.50	3.88	3.99	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.25	0.25	4.10	4.28	4.38	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.00	0.50	10.55	10.51	10.88	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	0.25	6.45	6.24	6.50	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.85	3.95	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.25	5.30	5.86	6.43	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	6.25	0.75	5.65	6.84	8.66	10.25	1.75	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.789	-3.00	1.824	1.848	1.850	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.845	-5.70	1.909	1.948	1.967	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	1.902	-5.50	1.967	2.010	2.050	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	1.930	-5.20	2.001	2.064	2.116	2.315	1.617	2.880	1.200
4Y	2.025	-4.40	2.098	2.173	2.251	2.502	1.755	3.060	1.232
5Y	2.142	-3.80	2.214	2.298	2.366	2.602	1.805	3.180	1.217
7Y	2.273	-3.30	2.336	2.423	2.492	2.728	2.024	3.303	1.270
10Y	2.377	-2.80	2.435	2.520	2.582	2.815	2.115	3.550	1.355
20Y	2.357	-2.50	2.402	2.496	2.572	2.792	2.197	3.743	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.49	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.78	0.16	108.63	108.88	108.58
LKTb	123.13	0.31	122.95	123.28	122.67

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	-1.65	1.25	-2.77	-2.10	-1.96	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-3.00	3.70	-6.17	-5.51	-6.13	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-5.45	3.25	-8.53	-7.00	-8.63	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.75	2.45	-7.19	-6.37	-7.74	-2.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-10.25	1.90	-12.77	-12.39	-15.89	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-18.45	1.30	-20.83	-21.03	-23.42	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-27.30	1.05	-28.97	-29.20	-31.72	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-30.95	0.80	-32.38	-32.68	-34.19	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-22.70	1.25	-23.49	-23.43	-24.46	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1118.40 (-4.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-57.25	-0.75	1Y	1.2000	-2.50	1.6200	0.8050	1*2Y	0.00	0.50		
-61.00	0.00	1.5Y	1.2050	-2.00	1.6600	0.8600	2*3Y	4.50	0.00		
-64.75	0.25	2Y	1.2000	-2.00	1.6950	0.9250	2*5Y	13.00	0.50		
-63.75	0.75	3Y	1.2450	-2.00	1.7550	0.9850	3*4Y	3.00	0.00		
-64.75	0.50	4Y	1.2750	-2.00	1.8000	1.0700	3*5Y	8.50	0.50		
-62.75	1.00	5Y	1.3300	-1.50	1.8500	1.0800	4*5Y	5.50	0.50		
-64.00	0.25	7Y	1.3600	-2.00	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	-0.50		
-51.75	0.00	10Y	1.5500	-2.00	2.0500	1.2200	5*10Y	22.00	-0.50		

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	2.5996	0.0165	2.5831	2.6121	2.6246	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.8334	0.0189	2.8145	2.8596	2.8650	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	69.76	7.15	62.61	64.71	62.46	69.76	-53.43	69.76	-245.00
10Y	45.64	4.69	40.95	43.26	39.50	45.64	-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	22.00	0.25	21.75	23.00	23.75	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	47.50	2.70	44.80	46.20	47.00	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	23.38	0.24	23.14	24.75	24.04	113.18	23.14	233.00	23.14

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	8Y 4.5						
06M									
09M									
01Y	78.5								
1.5Y	80								
02Y		SPRD	1*3Y 11.75						
03Y	90.25 / 86.75		4*5Y 3.5						
04Y			8*10Y 4.75						
05Y	98 / 95.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y CCS 20								
	2y CCS 21								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	165 건	72	93	140	141	80	86	86	
금 액	50,100 억원	24,815	25,285	52,085	66,420	27,100	27,780	27,780	

장중동향

국고채 금리, 靑 관계자 발언에 단가물을 중심으로 강세를 보이며 금리 하락. 금리 11개월래 최저치.
 간밤 '금리인상이 불편하다'는 도널드 트럼프 미 대통령 발언으로 인한 미 국채 금리 하락 영향에 더불어,
 한국시장 오후 2시 무렵, 청와대 고위 관계자의 '美 금리 인상 여파 있겠지만 우리에게 맞는 정책 써야'한다는 발언으로 금리 낙폭 심화.
 IRS, 전 구간 금리 하락. '연내 동결 프라이싱'
 靑 관계자 발언을 기점으로 국채선물이 상승 전환함에 따라 3Y와 5Y를 중심으로 기본되며 거래.
 CRS도 전 구간 금리 하락 마감.
 부채스왑이 거의 없는 가운데 오퍼리쉬한 분위기. 1-5Y 구간을 중심으로 호가가 활발했으며, 초이스 상황도 여러번.