

IPS Daily Morning Brief

2018-08-23

종가 기준일 2018-08-22

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7250	1.75	1.7240	1.7369	1.7224	1.7575	1.3900	2.6600	1.2875
9M	1.7725	2.25	1.7695	1.7875	1.7853	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.7975	2.50	1.7925	1.8254	1.8300	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8425	2.75	1.8400	1.8903	1.9046	2.0250	1.4700	2.7675	1.1900
2Y	1.8775	3.00	1.8740	1.9363	1.9620	2.1150	1.5000	2.8225	1.1675
3Y	1.9175	3.50	1.9185	1.9951	2.0351	2.2225	1.5550	2.9225	1.1550
4Y	1.9550	3.25	1.9575	2.0433	2.0881	2.2950	1.6050	3.0050	1.1575
5Y	1.9900	3.25	1.9925	2.0816	2.1278	2.3400	1.6475	3.0775	1.1575
7Y	2.0350	3.50	2.0335	2.1248	2.1714	2.3950	1.7050	3.1825	1.1675
10Y	2.1000	3.25	2.0995	2.1873	2.2363	2.4850	1.7825	3.2975	1.2125
12Y	2.1375	3.25	2.1370	2.2256	2.2758	2.5225	1.8175	3.3400	1.2150
15Y	2.1550	3.25	2.1530	2.2454	2.3005	2.5400	1.8250	3.3750	1.2150
20Y	2.1650	3.50	2.1580	2.2549	2.3224	2.5600	1.8250	3.4950	1.2150

6*9M	4.75	0.50	4.55	5.06	6.29	12.50	1.00	12.50	-6.00
9*12M	2.50	0.25	2.30	3.79	4.47	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	8.00	0.50	8.15	11.09	13.20	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	4.00	0.50	4.45	5.89	7.32	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.75	0.25	8.35	10.70	12.62	21.75	7.50	23.50	-1.75
2*5Y	11.25	0.25	11.85	14.54	16.58	27.25	11.00	34.00	-1.75
3*4Y	3.75	-0.25	3.90	4.81	5.30	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.25	-0.25	7.40	8.65	9.26	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.50	3.84	3.96	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.50	0.25	4.10	4.31	4.36	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.00	0.00	10.70	10.56	10.86	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	-0.25	6.60	6.25	6.50	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.84	3.95	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.35	5.81	6.41	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	6.50	0.25	5.85	6.76	8.61	10.25	1.75	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.786	-0.30	1.813	1.845	1.849	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.860	1.50	1.892	1.945	1.965	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	1.925	2.30	1.950	2.006	2.047	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	1.965	3.50	1.982	2.059	2.112	2.315	1.617	2.880	1.200
4Y	2.060	3.50	2.077	2.166	2.245	2.502	1.755	3.060	1.232
5Y	2.175	3.30	2.192	2.291	2.361	2.602	1.805	3.180	1.217
7Y	2.301	2.80	2.316	2.415	2.488	2.728	2.024	3.303	1.270
10Y	2.402	2.50	2.416	2.513	2.577	2.815	2.115	3.547	1.355
20Y	2.362	0.50	2.383	2.487	2.566	2.792	2.197	3.743	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.67	-0.11	108.74	108.79	108.67
LKTb	122.87	-0.26	123.07	123.26	122.87

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	1.15	2.80	-2.01	-2.00	-1.89	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-1.75	1.25	-5.18	-5.45	-6.06	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-4.75	0.70	-7.58	-6.93	-8.53	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.75	0.00	-6.39	-6.34	-7.67	-2.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-10.50	-0.25	-11.97	-12.28	-15.71	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-18.50	-0.05	-19.93	-20.92	-23.28	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-26.60	0.70	-28.29	-29.04	-31.61	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-30.20	0.75	-31.67	-32.54	-34.09	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-19.70	3.00	-22.54	-23.19	-24.34	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1118.90 (+0.50)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-61.75	-4.50	1Y	1.1800	-2.00	1.6200	0.8050	1*2Y	1.00	1.00
-65.75	-4.75	1.5Y	1.1850	-2.00	1.6600	0.8600	2*3Y	4.50	0.00
-68.75	-4.00	2Y	1.1900	-1.00	1.6950	0.9250	2*5Y	13.00	0.00
-68.25	-4.50	3Y	1.2350	-1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	3.00	0.00
-69.00	-4.25	4Y	1.2650	-1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	8.50	0.00
-67.00	-4.25	5Y	1.3200	-1.00	1.8500	1.0800	4*5Y	5.50	0.00
-68.50	-4.50	7Y	1.3500	-1.00	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00
-56.00	-4.25	10Y	1.5400	-1.00	2.0500	1.2200	5*10Y	22.00	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	2.6037	0.0041	2.5996	2.5831	2.6121	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.8198	-0.0136	2.8334	2.8145	2.8596	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	67.87	-1.89	69.76	62.61	64.71	69.76	-53.43	69.76	-245.00
10Y	41.78	-3.86	45.64	40.95	43.26	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	22.25	0.25	22.00	21.75	23.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	47.70	0.20	47.50	44.80	46.20	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	21.61	-1.77	23.38	23.14	24.75	113.18	21.61	231.00	21.61

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	79.75								
1.5Y	84 / 84.25								
02Y		SPRD	3*4Y 3.75						
03Y	89.75 / 90 / 90.75								
04Y	92.75 / 94.75								
05Y	96.25 / 98.25								
07Y									
10Y	9								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y CCS 17								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	146 건	-19	165	93	140	141	80	86	
금 액	47,215 억원	-2,885	50,100	25,285	52,085	66,420	27,100	27,780	

장종동향

국고채 금리, 상승 마감.

전일 강세에 따른 레벨 부담에 되돌림 장세가 나타남. 외국인의 이익 실현도 금리 상승 요인으로 작용.

IRS, 전 구간 금리 상승 마감.

국채선물은 혼조세로 출발했으나, 전일 강세에 대한 부담과 FOMC의사록 발표를 앞둔 불확실성에 다시 낙폭을 확대하며 하락 마감. 특히 3년이상 테너에서 비트 수요가 많았음.

CRS, 전 구간 금리 하락 마감.

장 초반 애셋스랩 물량과 전일 청와대 고위관계자 발언 영향으로 하락. 오후들어 포린비드가 나오며 낙폭을 일부 회복함.