

IPS Daily Morning Brief

2018-08-24

종가 기준일 2018-08-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7325	0.75	1.7230	1.7371	1.7226	1.7575	1.3900	2.6575	1.2875
9M	1.7800	0.75	1.7685	1.7875	1.7852	1.8300	1.4100	2.6800	1.2500
1Y	1.8075	1.00	1.7925	1.8245	1.8295	1.9100	1.4350	2.7075	1.2200
1.5Y	1.8500	0.75	1.8370	1.8876	1.9033	2.0250	1.4700	2.7650	1.1900
2Y	1.8825	0.50	1.8705	1.9325	1.9599	2.1150	1.5000	2.8200	1.1675
3Y	1.9225	0.50	1.9115	1.9900	2.0322	2.2225	1.5550	2.9200	1.1550
4Y	1.9575	0.25	1.9485	2.0374	2.0846	2.2950	1.6050	3.0025	1.1575
5Y	1.9925	0.25	1.9840	2.0754	2.1240	2.3400	1.6475	3.0750	1.1575
7Y	2.0375	0.25	2.0260	2.1188	2.1675	2.3950	1.7050	3.1825	1.1675
10Y	2.1025	0.25	2.0925	2.1814	2.2325	2.4850	1.7825	3.2975	1.2125
12Y	2.1400	0.25	2.1300	2.2196	2.2719	2.5225	1.8175	3.3400	1.2150
15Y	2.1550	0.00	2.1460	2.2389	2.2963	2.5400	1.8250	3.3725	1.2150
20Y	2.1650	0.00	2.1525	2.2481	2.3180	2.5600	1.8250	3.4925	1.2150

6*9M	4.75	0.00	4.55	5.04	6.26	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	2.75	0.25	2.40	3.70	4.43	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	7.50	-0.50	7.80	10.80	13.04	23.00	6.25	23.00	-5.50
2*3Y	4.00	0.00	4.10	5.75	7.23	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.50	-0.25	7.80	10.49	12.47	21.75	7.50	23.50	-1.75
2*5Y	11.00	-0.25	11.35	14.29	16.41	27.25	11.00	34.00	-1.75
3*4Y	3.50	-0.25	3.70	4.74	5.25	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.00	-0.25	7.25	8.54	9.19	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.55	3.80	3.94	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.50	0.00	4.20	4.34	4.35	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.00	0.00	10.85	10.60	10.84	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.65	6.26	6.49	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.83	3.94	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	-0.25	5.35	5.75	6.39	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	6.25	-0.25	6.00	6.68	8.55	10.25	1.75	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.790	0.40	1.802	1.843	1.848	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.852	-0.80	1.874	1.941	1.963	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	1.912	-1.30	1.932	2.001	2.044	2.230	1.577	2.805	1.225
3Y	1.965	0.00	1.966	2.053	2.108	2.315	1.617	2.880	1.200
4Y	2.060	0.00	2.060	2.159	2.240	2.502	1.755	3.060	1.232
5Y	2.175	0.00	2.174	2.284	2.356	2.602	1.805	3.180	1.217
7Y	2.297	-0.40	2.301	2.407	2.483	2.728	2.024	3.303	1.270
10Y	2.395	-0.70	2.401	2.505	2.572	2.815	2.115	3.547	1.355
20Y	2.345	-1.70	2.368	2.477	2.560	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	108.65	-0.02	108.68	108.75	108.65
LKTb	122.90	0.03	122.91	123.14	122.84

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.75	0.60	-0.99	-1.89	-1.83	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-0.20	1.55	-3.72	-5.31	-5.98	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-2.95	1.80	-6.17	-6.82	-8.40	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.25	0.50	-5.49	-6.34	-7.58	-3.20	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-10.25	0.25	-11.13	-12.21	-15.54	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-18.25	0.25	-19.04	-20.82	-23.15	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-25.95	0.65	-27.46	-28.86	-31.50	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-29.25	0.95	-30.87	-32.35	-33.98	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-18.00	1.70	-21.57	-22.88	-24.20	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1121.40 (+2.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-60.75	1.00	1Y	1.2000	2.00	1.6200	0.8050	1*2Y	1.00	0.00		
-64.50	1.25	1.5Y	1.2050	2.00	1.6600	0.8600	2*3Y	5.00	0.50		
-67.25	1.50	2Y	1.2100	2.00	1.6950	0.9250	2*5Y	13.50	0.50		
-66.25	2.00	3Y	1.2600	2.50	1.7550	0.9850	3*4Y	3.00	0.00		
-66.75	2.25	4Y	1.2900	2.50	1.8000	1.0700	3*5Y	8.50	0.00		
-64.75	2.25	5Y	1.3450	2.50	1.8500	1.0800	4*5Y	5.50	0.00		
-66.25	2.25	7Y	1.3750	2.50	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00		
-53.75	2.25	10Y	1.5650	2.50	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	2.6162	0.0125	2.6037	2.5996	2.5831	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.8288	0.0090	2.8198	2.8334	2.8145	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	70.42	2.55	67.87	69.76	62.61	70.42	-53.43	70.42	-245.00
10Y	43.38	1.60	41.78	45.64	40.95	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	22.25	22.00	21.75	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	48.30	0.60	47.70	47.50	44.80	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	21.26	-0.35	21.61	23.38	23.14	113.18	21.26	227.00	21.26

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M	71.5 / 71.75								
09M	78 / 78.25								
01Y	79 / 80.25 / 80.5								
1.5Y									
02Y	86.25 / 86.5 / 87.75	SPRD	2*10y		22				
03Y	90.5 / 92.25								
04Y	93.75 / 94.5		6*9*12m		02				
05Y	97.25 / 97.5								
07Y	1.5								
10Y	8								
12Y									
15Y	14.5 / 15.25 / 15.5								
20Y									
CRS	1.5y CCS 18.5								
	3y CCS 26								
	4y CCS 27								
	10*15y CCS 00								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황		93 건	-53	146	165	93	140	141	80
금 액		32,685 억원	-14,530	47,215	50,100	25,285	52,085	66,420	27,100

장중동향
 채권금리 혼조마감.
 전일 약세를 되돌리며 강세 출발한 채권은 하락한 증시가 반등함에 따라 하락세로 전환 보합마감.

IRS는 레벨상승, 커브 플랫 마감.
 장중 선물의 움직임에따라 레벨변화. 상승했던 채권가격이 하락하면서 비드가 중단기쪽으로 집중. 단기물이 상대적으로 오르면서 커브 플랫 마감.

CRS는 전테너 2 ~ 2.5bp 상승마감.