

IPS Daily Morning Brief

2018-08-28

종가 기준일 2018-08-27

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7250	-0.25	1.7235	1.7340	1.7227	1.7575	1.3900	2.6550	1.2875
9M	1.7775	0.25	1.7710	1.7838	1.7846	1.8300	1.4100	2.6775	1.2500
1Y	1.8050	0.25	1.7970	1.8185	1.8280	1.9100	1.4350	2.7025	1.2200
1.5Y	1.8450	0.25	1.8390	1.8778	1.9003	2.0250	1.4700	2.7550	1.1900
2Y	1.8725	0.00	1.8705	1.9196	1.9552	2.1150	1.5000	2.8075	1.1675
3Y	1.9075	-0.25	1.9080	1.9743	2.0254	2.2225	1.5550	2.9050	1.1550
4Y	1.9425	-0.25	1.9445	2.0204	2.0767	2.2950	1.6050	2.9875	1.1575
5Y	1.9775	0.00	1.9790	2.0581	2.1155	2.3400	1.6475	3.0550	1.1575
7Y	2.0175	-0.75	2.0230	2.1024	2.1586	2.3950	1.7050	3.1600	1.1675
10Y	2.0825	-0.25	2.0875	2.1653	2.2233	2.4850	1.7825	3.2750	1.2125
12Y	2.1200	-0.25	2.1250	2.2033	2.2626	2.5225	1.8175	3.3200	1.2150
15Y	2.1350	-0.25	2.1410	2.2215	2.2867	2.5400	1.8250	3.3625	1.2150
20Y	2.1450	-0.25	2.1505	2.2303	2.3076	2.5600	1.8250	3.4825	1.2150

6*9M	5.25	0.50	4.75	4.98	6.19	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	2.75	0.00	2.60	3.48	4.34	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	6.75	-0.25	7.35	10.11	12.72	23.00	6.25	23.00	-5.50
2*3Y	3.50	-0.25	3.75	5.46	7.03	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.00	-0.25	7.40	10.08	12.15	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	10.50	0.00	10.85	13.85	16.03	27.25	10.50	34.00	-1.75
3*4Y	3.50	0.00	3.65	4.61	5.13	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.00	0.25	7.10	8.39	9.01	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.25	3.45	3.78	3.88	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	-0.75	4.40	4.43	4.31	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.50	-0.25	10.85	10.71	10.78	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.50	6.45	6.29	6.47	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.80	3.93	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.35	5.63	6.34	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	6.25	0.00	6.30	6.50	8.43	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	0.00	1.789	1.836	1.846	1.935	1.400	2.688	1.237
1.5Y	1.856	0.50	1.853	1.929	1.959	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	1.907	0.00	1.911	1.986	2.037	2.230	1.577	2.802	1.225
3Y	1.959	0.20	1.955	2.037	2.100	2.315	1.617	2.877	1.200
4Y	2.060	0.30	2.052	2.142	2.229	2.502	1.755	3.048	1.232
5Y	2.172	0.00	2.167	2.265	2.345	2.602	1.805	3.170	1.217
7Y	2.290	-0.40	2.291	2.389	2.472	2.728	2.024	3.291	1.270
10Y	2.363	-1.40	2.383	2.485	2.561	2.815	2.115	3.527	1.355
20Y	2.332	-1.00	2.348	2.456	2.548	2.792	2.197	3.733	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.52	3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.73	0.03	108.68	108.73	108.66
LKTB	123.26	0.13	123.07	123.29	123.07

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.50	0.25	0.80	-1.73	-1.82	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-1.10	-0.25	-1.38	-5.14	-5.88	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-3.45	0.00	-4.01	-6.65	-8.19	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-5.15	-0.45	-4.72	-6.31	-7.46	-3.20	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-11.75	-0.55	-10.79	-12.13	-15.24	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-19.45	0.00	-18.82	-20.65	-22.93	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-27.25	-0.35	-26.80	-28.63	-31.32	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-28.05	1.15	-29.53	-31.96	-33.74	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-18.70	0.75	-19.71	-22.54	-24.00	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1113.80 (-5.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-56.00	1.75	1Y	1.2450	2.00	1.6200	0.8050	1*2Y	1.50	0.50		
-59.50	1.75	1.5Y	1.2500	2.00	1.6600	0.8600	2*3Y	4.50	0.00		
-61.25	2.50	2Y	1.2600	2.50	1.6950	0.9250	2*5Y	13.00	0.00		
-60.25	2.75	3Y	1.3050	2.50	1.7550	0.9850	3*4Y	3.50	0.00		
-60.25	2.75	4Y	1.3400	2.50	1.8000	1.0700	3*5Y	8.50	0.00		
-58.75	2.50	5Y	1.3900	2.50	1.8500	1.0800	4*5Y	5.00	0.00		
-59.75	3.25	7Y	1.4200	2.50	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00		
-47.75	2.75	10Y	1.6050	2.50	2.0500	1.2200	5*10Y	21.50	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	2.6537	0.0209	2.6328	2.6162	2.6037	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.8459	0.0280	2.8179	2.8288	2.8198	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	74.67	2.09	72.58	70.42	67.87	74.67	-53.43	74.67	-245.00
10Y	48.29	4.20	44.09	43.38	41.78	48.29	-24.46	48.29	-89.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	21.00	-0.25	21.25	22.00	22.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	45.60	-1.40	47.00	48.30	47.70	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	19.22	0.71	18.51	21.26	21.61	113.18	18.51	227.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M	72.75								
09M									
01Y	80.5								
1.5Y									
02Y	87		SPRD	1*3y	10.25				
03Y	90.75 / 91 / 91.5			3*5y	6.75				
04Y	94.5								
05Y									
07Y									
10Y	8.25 / 8.5 / 09								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	79 건	2	77	93	146	165	93	140	
금 액	19,360 억원	-1,080	20,440	32,685	47,215	50,100	25,285	52,085	

장중동향

채권 장기를 강세 커브플래트닝.
금통위의 연내인상 여부와 스탠스의 변화에 대한 기대감으로 보합권 등락.

IRS는 금통위를 앞두고 보합권에서 혼조.
단기부터 장기까지 전반적으로 거래가 이루어졌고, 2년-3년 구간 거래가 주를 이룸.

CRS는 전테너 2-2.5bp 상승 마감.