IPS Daily Morning Brief

2018-08-29

종가 기준일 2018-08-28

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7200	-0.50	1.7260	1.7323	1.7226	1.7575	1.3900	2.6550	1.2875
9M	1.7775	0.00	1.7765	1.7820	1.7842	1.8300	1.4100	2.6775	1.2500
1Y	1.8050	0.00	1.8035	1.8156	1.8271	1.9100	1.4350	2.7025	1.2200
1.5Y	1.8525	0.75	1.8465	1.8733	1.8988	2.0250	1.4700	2.7550	1.1900
2Y	1.8825	1.00	1.8775	1.9136	1.9528	2.1150	1.5000	2.8050	1.1675
3Y	1.9225	1.50	1.9160	1.9670	2.0221	2.2225	1.5550	2.9025	1.1550
4Y	1.9575	1.50	1.9515	2.0126	2.0728	2.2950	1.6050	2.9850	1.1575
5Y	1.9925	1.50	1.9860	2.0505	2.1113	2.3400	1.6475	3.0525	1.1575
7Y	2.0325	1.50	2.0295	2.0951	2.1541	2.3950	1.7050	3.1575	1.1675
10Y	2.0925	1.00	2.0925	2.1581	2.2186	2.4850	1.7825	3.2750	1.2125
12Y	2.1300	1.00	2.1300	2.1960	2.2579	2.5225	1.8175	3.3200	1.2150
15Y	2.1450	1.00	2.1455	2.2139	2.2818	2.5400	1.8250	3.3625	1.2150
20Y	2.1550	1.00	2.1555	2.2224	2.3024	2.5600	1.8250	3.4825	1.2150

6*9M	5.75	0.50	5.05	4.98	6.16	12.50	1.25	12.50	-6.00
9*12M	2.75	0.00	2.70	3.36	4.29	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	7.75	1.00	7.40	9.80	12.57	23.00	6.25	23.00	-5.50
2*3Y	4.00	0.50	3.85	5.34	6.93	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	7.50	0.50	7.40	9.90	11.99	21.75	7.00	23.50	-1.75
2*5Y	11.00	0.50	10.85	13.69	15.85	27.25	10.50	34.00	-1.75
3*4Y	3.50	0.00	3.55	4.56	5.06	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.00	0.00	7.00	8.35	8.92	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.45	3.79	3.85	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.00	4.35	4.46	4.28	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	-0.50	10.65	10.76	10.73	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.00	-0.50	6.30	6.30	6.45	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.79	3.93	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.30	5.58	6.31	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	6.25	0.00	6.30	6.43	8.38	10.25	1.75	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.800	1.00	1.791	1.832	1.845	1.935	1.400	2.683	1.237
1.5Y	1.862	0.60	1.856	1.923	1.957	2.113	1.517	2.742	1.232
2Y	1.910	0.30	1.912	1.979	2.034	2.230	1.577	2.795	1.225
3Y	1.965	0.60	1.962	2.029	2.096	2.315	1.617	2.872	1.200
4Y	2.066	0.60	2.061	2.133	2.224	2.502	1.755	3.043	1.232
5Y	2.175	0.30	2.174	2.255	2.339	2.602	1.805	3.165	1.217
7Y	2.290	0.00	2.294	2.379	2.466	2.728	2.024	3.286	1.270
10Y	2.357	-0.60	2.379	2.474	2.554	2.815	2.115	3.526	1.355
20Y	2.325	-0.70	2.341	2.445	2.541	2.792	2.197	3.722	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.50	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.72	-0.01	108.69	108.74	108.67
LKTB	123.35	0.09	123.15	123.42	123.05

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	0.50	-1.00	1.23	-1.64	-1.83	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-0.95	0.15	-0.97	-4.96	-5.83	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-2.75	0.70	-3.47	-6.49	-8.08	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.25	0.90	-4.62	-6.24	-7.38	-3.20	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-10.85	0.90	-10.91	-12.06	-15.08	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-18.25	1.20	-18.78	-20.48	-22.81	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-25.75	1.50	-26.49	-28.40	-31.20	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-26.45	1.60	-28.63	-31.61	-33.57	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-17.00	1.70	-18.57	-22.23	-23.86	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-54.50	1.50
-58.25	1.25
-59.75	1.50
-59.25	1.00
-59.25	1.00
-57.75	1.00
-58.75	1.00
-46.25	1.50

CRS

USD/KRW 1110.00 (-3.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2600	1.50	1.6200	0.8050	1*2Y	2.50	1.00
1.5Y	1.2700	2.00	1.6600	0.8600	2*3Y	4.50	0.00
2Y	1.2850	2.50	1.6950	0.9250	2*5Y	13.00	0.00
3Y	1.3300	2.50	1.7550	0.9850	3*4Y	3.50	0.00
4Y	1.3650	2.50	1.8000	1.0700	3*5Y	8.50	0.00
5Y	1.4150	2.50	1.8500	1.0800	4*5Y	5.00	0.00
7Y	1.4450	2.50	1.8950	1.1050	5*7Y	3.00	0.00
10Y	1.6300	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	2.6692	0.0155	2.6537	2.6328	2.6162	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.8759	0.0300	2.8459	2.8179	2.8288	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	75.92	1.25	74.67	72.58	70.42	75.92	-53.43	75.92	-245.00
10Y	51.89	3.60	48.29	44.09	43.38	51.89	-24.46	51.89	-89.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	21.00	0.00	21.00	21.25	22.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	44.70	-0.90	45.60	47.00	48.30	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	20.67	1.45	19.22	18.51	21.26	110.45	18.51	227.00	18.51

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	88	SPRD	
03Y	91.5 / 92		
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	9.75 / 9.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1Y CCS 1.255 2Y CCS 1.28		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	89 건	10	79	77	93	146	165	93
금 액	29,060 억원	9,700	19,360	20,440	32,685	47,215	50,100	25,285

장중동향

국고채 금리, 보합권에서 혼조세로 마감.
단기물 금리 소폭 상승, 장기물 금리 하락. 커브플래트닝.

IRS, 1년 이하 단기구간을 제외하고 상승마감.
역외를 중심으로 3년 이상 구간에서 매도가 이어짐. 특히, 국채선물 움직임과는 달리 3~5년 구간에서 매도가 장중 내내 나오며 활발히 거래됨.

CRS는 전테너 1.5-2.5bp 상승 마감.