IPS Daily Morning Brief

2018-07-03

종가 기준일 2018-07-02

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7050	-0.50	1.7095	1.7203	1.7254	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7650	-1.25	1.7780	1.7951	1.7946	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8000	-2.00	1.8210	1.8456	1.8533	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8700	-2.50	1.8945	1.9291	1.9483	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9275	-3.00	1.9570	1.9969	2.0218	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0000	-3.00	2.0300	2.0826	2.1159	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0475	-3.25	2.0820	2.1438	2.1800	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.0825	-3.25	2.1175	2.1859	2.2243	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1225	-3.25	2.1585	2.2323	2.2730	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.1825	-3.25	2.2200	2.2998	2.3421	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2225	-3.25	2.2600	2.3398	2.3839	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2500	-3.25	2.2875	2.3673	2.4076	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.2800	-3.25	2.3185	2.3985	2.4350	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150
6*9M	6.00	-0.75	6.85	7.49	6.92	12.50	0.00	12.50	-6.00
9*12M	3.50	-0.75	4.30	5.05	5.87	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	12.75	-1.00	13.60	15.13	16.85	23.00	3.50	23.00	-5.50
2*3Y	7.25	0.00	7.30	8.58	9.41	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	12.00	-0.25	12.50	14.69	15.82	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	15.50	-0.25	16.05	18.90	20.25	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.75	-0.25	5.20	6.11	6.41	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.25	-0.25	8.75	10.33	10.84	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.55	4.21	4.43	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.00	4.10	4.64	4.87	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	0.00	10.25	11.39	11.78	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.00	0.00	6.15	6.75	6.91	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.18	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.75	6.55	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.00	9.85	9.88	9.29	10.25	-6.25	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.858	-0.50	1.868	1.868	1.861	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.973	-0.20	1.980	2.009	2.019	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.055	-0.50	2.066	2.101	2.125	2.230	1.577	2.818	1.225
3Y	2.122	0.00	2.124	2.171	2.206	2.315	1.617	2.913	1.200
4Y	2.237	-0.90	2.254	2.329	2.378	2.502	1.755	3.125	1.232
5Y	2.340	-1.10	2.360	2.435	2.474	2.602	1.805	3.208	1.217
7Y	2.459	-1.90	2.488	2.564	2.600	2.728	2.024	3.370	1.270
10Y	2.530	-2.50	2.565	2.648	2.694	2.815	2.115	3.585	1.355
20Y	2.545	-1.00	2.566	2.642	2.694	2.792	2.175	3.799	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.53	-4.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.10	0.04	108.03	108.10	107.99
LKTB	121.45	0.25	121.10	121.51	121.08

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	-5.80	-1.50	-4.74	-2.25	-0.75	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-10.30	-2.30	-8.59	-8.03	-7.02	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-12.75	-2.50	-10.92	-10.40	-10.33	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-12.20	-3.00	-9.38	-8.80	-9.04	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-18.95	-2.35	-17.16	-18.55	-19.76	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-25.75	-2.15	-24.29	-24.90	-24.99	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.65	-1.35	-32.95	-33.17	-32.70	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-34.75	-0.75	-34.54	-34.86	-35.21	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.50	-2.25	-24.79	-24.33	-25.89	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-65.50	3.00
-71.00	3.50
-74.75	3.00
-76.50	2.50
-79.75	1.25
-80.75	-0.25
-77.75	-0.75
-62.75	-0.75

CRS

USD/KRW 1120.00 (+5.50)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1450	1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	3.50	-1.00
1.5Y	1.1600	1.00	1.6600	0.8100	2*3Y	5.50	-0.50
2Y	1.1800	0.00	1.6950	0.8650	2*5Y	9.50	-3.50
3Y	1.2350	-0.50	1.7550	0.9550	3*4Y	1.50	-1.50
4Y	1.2500	-2.00	1.8000	1.0150	3*5Y	4.00	-3.00
5Y	1.2750	-3.50	1.8500	1.0350	4*5Y	2.50	-1.50
7Y	1.3450	-4.00	1.8950	1.0400	5*7Y	7.00	-0.50
10Y	1.5550	-4.00	2.0500	1.0500	5*10Y	28.00	-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	2.5567	0.0284	2.5283	2.5120	2.4953	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.8687	0.0073	2.8614	2.8386	2.8259	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	50.17	3.34	46.83	45.30	42.83	50.17	-53.43	50.17	-251.80
10Y	33.87	3.23	30.64	27.86	25.09	36.30	-24.46	47.40	-98.50

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	25.50	-0.25	25.75	25.75	26.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	47.50	-2.00	49.50	50.10	50.80	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	31.20	-2.11	33.31	32.66	33.06	126.91	31.20	242.00	31.20

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	93.25 / 97 / 94.25	SPRD	1*2Y 14.25
03Y	3.25 / 03 / 4.5		
04Y			
05Y	11 / 08 / 8.25		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	40 건	-28	68	100	100	63	45	124
금 액	7,750 억원	-6,880	14,630	27,805	25,388	15,275	30,780	45,310

장중동향

국고채 금리, 아시아 주식시장 급락 영향을 받으며 3년물 상승 & 10년물 하락 혼조세.

IRS, 시장 전반적으로 안전자산 선호 현상에 커진데 영향을 받아 금리 하락.
거래량이 많지 않은 가운데 2-3Y을 중심으로 거래. 단기 구간으로 헤지펀드의 공격적인 오퍼 출현.

CRS, 3Y 이상 구간에서 금리가 하락하며 혼조세 마감.
5Y을 중심으로 강한 오퍼 출현.