IPS Daily Morning Brief

2018-07-13

종가 기준일 2018-07-12

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7125	1.75	1.7005	1.7109	1.7227	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7850	2.75	1.7665	1.7816	1.7930	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8350	4.00	1.8085	1.8263	1.8500	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9100	5.00	1.8775	1.9004	1.9418	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9600	5.50	1.9300	1.9600	2.0144	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0275	5.25	2.0030	2.0356	2.1070	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0675	4.75	2.0490	2.0880	2.1706	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.1000	4.75	2.0835	2.1243	2.2140	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1350	4.25	2.1240	2.1663	2.2628	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2000	4.25	2.1890	2.2309	2.3310	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2400	4.25	2.2290	2.2709	2.3721	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2675	4.25	2.2565	2.2984	2.3968	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.2975	4.25	2.2865	2.3296	2.4252	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150
6*9M	7.25	1.00	6.60	7.08	7.03	12.50	0.00	12.50	-6.00
9*12M	5.00	1.25	4.20	4.46	5.70	10.50	0.25	10.50	-4.25
1*2Y	12.50	1.50	12.15	13.38	16.45	23.00	4.75	23.00	-5.50
2*3Y	6.75	-0.25	7.30	7.56	9.26	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	10.75	-0.75	11.90	12.80	15.62	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	14.00	-0.75	15.35	16.43	19.96	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.00	-0.50	4.60	5.24	6.36	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.25	-0.50	8.05	8.86	10.70	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.45	3.63	4.34	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.50	-0.50	4.05	4.20	4.87	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	-0.50	10.55	10.66	11.69	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.50	6.46	6.82	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.11	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.75	6.58	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.00	9.75	9.87	9.43	10.25	-2.50	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.851	4.90	1.823	1.858	1.859	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.945	5.10	1.922	1.975	2.010	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.030	5.30	2.011	2.060	2.115	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.090	4.30	2.086	2.125	2.196	2.315	1.617	2.890	1.200
4Y	2.215	4.00	2.214	2.263	2.362	2.502	1.755	3.089	1.232
5Y	2.330	3.80	2.332	2.372	2.466	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.462	4.00	2.461	2.500	2.592	2.728	2.024	3.320	1.270
10Y	2.547	4.00	2.543	2.579	2.685	2.815	2.115	3.567	1.355
20Y	2.535	2.50	2.539	2.577	2.683	2.792	2.175	3.785	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.15	-0.16	108.27	108.28	108.06
LKTB	121.34	-0.41	121.64	121.70	121.33

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	-1.60	-0.90	-1.43	-3.17	-0.85	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-3.50	-0.10	-4.43	-7.51	-6.77	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-7.00	0.20	-8.10	-10.05	-10.09	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-6.25	0.95	-8.30	-8.93	-8.92	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-14.75	0.75	-16.48	-17.52	-19.17	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-23.00	0.95	-24.89	-24.79	-25.17	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.70	0.25	-33.66	-33.39	-32.93	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-34.70	0.25	-35.42	-34.79	-35.44	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-23.75	1.75	-25.29	-24.77	-25.81	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-57.50	-2.00
-62.00	-3.00
-65.50	-3.50
-66.25	-2.75
-65.25	-1.25
-63.50	-1.25
-62.50	-1.75
-48.50	-2.25

CRS

USD/KRW 1125.90 (+5.90)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2600	2.00	1.6200	0.7650	1*2Y	4.50	0.00
1.5Y	1.2900	2.00	1.6600	0.8100	2*3Y	6.00	0.50
2Y	1.3050	2.00	1.6950	0.8650	2*5Y	16.00	1.50
3Y	1.3650	2.50	1.7550	0.9550	3*4Y	5.00	1.00
4Y	1.4150	3.50	1.8000	1.0150	3*5Y	10.00	1.00
5Y	1.4650	3.50	1.8500	1.0350	4*5Y	5.00	0.00
7Y	1.5100	2.50	1.8950	1.0400	5*7Y	4.50	-1.00
10Y	1.7150	2.00	2.0500	1.0500	5*10Y	25.00	-1.50

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	2.6065	0.0206	2.5859	2.5694	2.5612	2.6065	1.1428	2.6065	0.3100
10Y	2.8451	-0.0027	2.8478	2.8570	2.8607	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	57.65	-3.24	60.89	56.24	54.12	60.89	-53.43	60.89	-245.00
10Y	29.81	-4.27	34.08	30.70	30.37	36.30	-24.46	47.40	-91.80

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	24.00	-1.25	25.25	26.50	26.75	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	51.70	-1.30	53.00	54.30	53.70	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	23.86	-2.33	26.19	28.76	29.95	124.46	23.86	237.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	77		
01Y	80.5 / 81 / 83.5		
1.5Y	87 / 88 / 88.5 / 90.5		
02Y		SPRD	
03Y			
04Y	3.5 / 05 / 6.25		
05Y			
07Y	13.5		
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1*2Y CCS 4.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	110 건	6	104	41	45	65	154	81
금 액	40,528 억원	2,693	37,835	10,570	10,440	20,733	46,865	29,300

장중동향

국고채 금리, 금통위 소수 의견을 반영하면서 금리 상승.

IRS, 금통위 금리 인상 소수 의견에 반응하며 금리 상승 마감.
소수의견 등장에 그동안 오퍼리시하던 단기구간을 위주로 비드 출현.
1.5Y을 중심으로 테이큰되면서 활발한 움직임.

CRS, 부채스왑 영향으로 금리 상승 마감.