

IPS Daily Morning Brief

2018-07-02

종가 기준일 2018-06-29

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7100	0.25	1.7130	1.7214	1.7254	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7775	0.00	1.7835	1.7969	1.7945	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8200	0.00	1.8295	1.8484	1.8535	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8950	0.25	1.9045	1.9328	1.9488	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9575	0.25	1.9680	2.0016	2.0224	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0300	0.25	2.0410	2.0886	2.1167	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0800	0.25	2.0945	2.1510	2.1810	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.1150	0.25	2.1310	2.1940	2.2254	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1550	0.25	2.1730	2.2413	2.2743	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2150	0.25	2.2360	2.3093	2.3436	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2550	0.25	2.2760	2.3493	2.3855	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2825	0.25	2.3035	2.3768	2.4090	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3125	0.25	2.3355	2.4080	2.4363	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150

6*9M	6.75	-0.25	7.05	7.55	6.92	12.50	0.00	12.50	-6.00
9*12M	4.25	0.00	4.60	5.15	5.90	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	13.75	0.25	13.85	15.33	16.89	23.00	3.50	23.00	-5.50
2*3Y	7.25	0.00	7.30	8.70	9.43	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	12.25	0.00	12.65	14.94	15.86	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	15.75	0.00	16.30	19.24	20.30	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	5.35	6.24	6.43	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.50	0.00	9.00	10.54	10.87	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.65	4.30	4.45	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.00	4.20	4.73	4.89	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	0.00	10.50	11.53	11.82	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.00	0.00	6.30	6.80	6.93	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.19	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	9.95	9.88	9.28	10.25	-6.25	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.863	0.10	1.873	1.867	1.861	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.975	0.00	1.985	2.010	2.019	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.060	0.10	2.073	2.104	2.126	2.230	1.577	2.818	1.225
3Y	2.122	0.70	2.127	2.175	2.207	2.315	1.617	2.913	1.200
4Y	2.246	0.10	2.262	2.337	2.379	2.502	1.755	3.125	1.232
5Y	2.351	0.00	2.370	2.443	2.475	2.602	1.805	3.208	1.217
7Y	2.478	-0.30	2.500	2.573	2.601	2.728	2.024	3.370	1.270
10Y	2.555	-0.50	2.579	2.659	2.696	2.815	2.115	3.585	1.355
20Y	2.555	-0.50	2.577	2.651	2.695	2.792	2.175	3.799	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.57	12.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.06	0.00	108.08	108.10	108.00
LKTB	121.20	0.04	121.18	121.33	120.97

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	-4.30	-0.10	-4.37	-1.88	-0.73	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-8.00	0.25	-8.05	-7.71	-7.01	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.25	0.15	-10.48	-10.25	-10.33	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-9.20	-0.45	-8.58	-8.64	-9.03	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-16.60	0.15	-16.77	-18.62	-19.82	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-23.60	0.25	-23.94	-24.91	-24.98	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.30	0.55	-32.72	-33.13	-32.67	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-34.00	0.75	-34.34	-34.93	-35.20	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.25	0.75	-24.13	-24.28	-25.88	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1114.50 (-9.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-68.50	-0.50	1Y	1.1350	-0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	4.50	-0.50	
-74.50	-1.25	1.5Y	1.1500	-1.00	1.6600	0.8100	2*3Y	6.00	0.00	
-77.75	-1.25	2Y	1.1800	-1.00	1.6950	0.8650	2*5Y	13.00	-1.00	
-79.00	-1.25	3Y	1.2400	-1.00	1.7550	0.9550	3*4Y	3.00	-1.00	
-81.00	-2.25	4Y	1.2700	-2.00	1.8000	1.0150	3*5Y	7.00	-1.00	
-80.50	-2.25	5Y	1.3100	-2.00	1.8500	1.0350	4*5Y	4.00	0.00	
-77.00	-2.75	7Y	1.3850	-2.50	1.8950	1.0400	5*7Y	7.50	-0.50	
-62.00	-7.25	10Y	1.5950	-7.00	2.0500	1.0500	5*10Y	28.50	-5.00	

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	2.5283	0.0163	2.5120	2.4953	2.5287	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.8614	0.0228	2.8386	2.8259	2.8842	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	46.83	1.53	45.30	42.83	43.87	46.83	-53.43	46.83	-251.80
10Y	30.64	2.78	27.86	25.09	27.72	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	25.75	0.00	25.75	26.00	28.50	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	49.50	-0.60	50.10	50.80	51.70	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	33.31	0.65	32.66	33.06	35.55	126.91	32.66	242.00	32.66

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6Y 12.5						
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y		SPRD	12*20Y 5.75						
03Y			1*2Y 13.75						
04Y	7 / 7.25								
05Y	10.75								
07Y									
10Y	20								
12Y									
15Y	27.25								
20Y									
CRS	1Y CCS 13.5								
	2Y CCS 18								
	3Y CCS 24								
	2*2Y CCS 06								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	68 건	-32	100	100	63	45	124	80	
금 액	14,630 억원	-13,175	27,805	25,388	15,275	30,780	45,310	24,520	

장중동향
 국고채 금리, 3년물은 상승했고 10년물은 하락하며 혼조세 .
 EU 정상 회의가 난민 문제에 합의하면서 상승세로 전환했다가 외국인의 저가 매수세 유입으로 보합세로 마감.

IRS 금리, 9개월과 1년을 제외하고 전 구간에서 소폭 상승.
 반기 말을 맞아 커브 플레이가 나타난 가운데 9개월과 1년은 오퍼가 우위를 보임. 역외 발 오퍼에 관심이 집중된 가운데 7월 금통위 소수의견에 대한 불확실성이 점증하는 모습.

CRS 금리, 전 구간 하락마감.