

IPS Daily Morning Brief

2018-07-06

종가 기준일 2018-07-05

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6925	-0.50	1.7015	1.7164	1.7248	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7525	-0.50	1.7640	1.7895	1.7942	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.7925	-0.50	1.8035	1.8376	1.8523	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8500	-1.25	1.8715	1.9175	1.9461	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9100	-1.00	1.9320	1.9823	2.0197	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	1.9875	-1.00	2.0085	2.0648	2.1135	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0375	-1.00	2.0585	2.1230	2.1777	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.0725	-1.00	2.0935	2.1626	2.2218	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1175	-0.75	2.1365	2.2075	2.2705	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.1825	-0.50	2.1985	2.2739	2.3393	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2225	-0.50	2.2385	2.3139	2.3809	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2500	-0.50	2.2660	2.3414	2.4050	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.2800	-0.50	2.2960	2.3726	2.4328	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150

6*9M	6.00	0.00	6.25	7.31	6.94	12.50	0.00	12.50	-6.00
9*12M	4.00	0.00	3.95	4.81	5.81	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	11.75	-0.50	12.85	14.46	16.74	23.00	3.50	23.00	-5.50
2*3Y	7.75	0.00	7.65	8.25	9.39	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	12.75	0.00	12.65	14.08	15.80	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	16.25	0.00	16.15	18.04	20.21	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	5.00	5.83	6.42	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.50	0.00	8.50	9.79	10.82	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.50	3.96	4.40	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.50	0.25	4.30	4.49	4.88	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.00	0.50	10.50	11.13	11.76	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.25	6.20	6.64	6.88	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.15	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.75	6.56	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.00	9.75	9.88	9.34	10.25	-6.25	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.821	-1.80	1.846	1.867	1.860	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.926	-2.10	1.958	2.001	2.016	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.017	-2.30	2.047	2.087	2.123	2.230	1.577	2.810	1.225
3Y	2.090	-2.00	2.116	2.156	2.204	2.315	1.617	2.895	1.200
4Y	2.219	-1.80	2.241	2.305	2.373	2.502	1.755	3.110	1.232
5Y	2.332	-1.50	2.350	2.412	2.472	2.602	1.805	3.198	1.217
7Y	2.465	-0.70	2.475	2.541	2.599	2.728	2.024	3.350	1.270
10Y	2.548	0.00	2.552	2.622	2.693	2.815	2.115	3.580	1.355
20Y	2.555	-0.30	2.559	2.618	2.692	2.792	2.175	3.797	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.46	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.17	0.08	108.09	108.19	108.08
LKTb	121.34	0.03	121.25	121.58	121.19

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-2.85	1.30	-4.25	-2.92	-0.78	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.60	0.85	-8.69	-8.37	-6.94	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.70	1.30	-11.54	-10.51	-10.30	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-10.25	1.00	-10.77	-9.15	-9.02	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-18.15	0.80	-18.21	-18.22	-19.56	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-25.95	0.50	-25.65	-24.89	-25.07	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-34.75	-0.05	-33.89	-33.38	-32.80	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-36.55	-0.50	-35.31	-34.79	-35.33	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-27.50	-0.20	-26.26	-24.55	-25.91	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1118.60 (+4.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-58.25	2.00	1Y	1.2100	1.50	1.6200	0.7650	1*2Y	2.50	0.00	
-62.50	2.75	1.5Y	1.2250	1.50	1.6600	0.8100	2*3Y	6.50	0.50	
-67.50	2.50	2Y	1.2350	1.50	1.6950	0.8650	2*5Y	13.00	0.50	
-68.75	3.00	3Y	1.3000	2.00	1.7550	0.9550	3*4Y	2.50	0.00	
-71.25	3.00	4Y	1.3250	2.00	1.8000	1.0150	3*5Y	6.50	0.00	
-70.75	3.00	5Y	1.3650	2.00	1.8500	1.0350	4*5Y	4.00	0.00	
-69.25	2.75	7Y	1.4250	2.00	1.8950	1.0400	5*7Y	6.00	0.00	
-54.75	2.50	10Y	1.6350	2.00	2.0500	1.0500	5*10Y	27.00	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	2.5528	0.0204	2.5324	2.5324	2.5567	2.5892	1.1410	2.5892	0.3100
10Y	2.8342	0.0030	2.8312	2.8312	2.8687	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	53.58	4.34	49.24	46.74	50.17	53.58	-53.43	53.58	-248.00
10Y	28.62	0.30	28.32	25.42	33.87	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	27.25	0.50	26.75	28.00	25.50	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	53.10	2.30	50.80	51.20	47.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	28.14	-1.74	29.88	29.88	31.20	125.87	28.14	242.00	28.14

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	70.25								
09M									
01Y	80								
1.5Y	84.5 / 84.75 / 85 / 85.75 / 85.25								
02Y	92.75 / 92 / 90 / 90.5				SPRD	3*5Y 7.75			
03Y	97.25					5*8Y 6.25			
04Y	2.5 / 2.25								
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	154 건		73	81	129	40	68	100	100
금 액	46,865 억원		17,565	29,300	25,660	7,750	14,630	27,805	25,388

장중동향
 국고채 금리, 하락마감 .
 무역 분쟁 우려가 이어지는 가운데 매수 심리가 강해진 영향.

IRS 금리, 하락마감.
 국채선물 움직임에 연동. 이번 주 이어진 역외 발 오피에 대응해서 오늘은 저점 레벨에서 스왑 비드가 역외 등에서 강하게 유입. 특히 3년 이하 구간에서 거래가 많았음.

CRS 금리, 전 구간 상승마감.