

IPS Daily Morning Brief

2018-07-09

종가 기준일 2018-07-06

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6950	0.25	1.6985	1.7154	1.7243	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7575	0.50	1.7600	1.7881	1.7939	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8000	0.75	1.7995	1.8355	1.8518	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8650	1.50	1.8655	1.9141	1.9452	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9225	1.25	1.9250	1.9780	2.0188	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0000	1.25	2.0025	2.0593	2.1125	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0500	1.25	2.0525	2.1165	2.1766	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.0850	1.25	2.0875	2.1555	2.2206	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1275	1.00	2.1310	2.1999	2.2694	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.1925	1.00	2.1940	2.2659	2.3380	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2325	1.00	2.2340	2.3059	2.3795	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2600	1.00	2.2615	2.3334	2.4037	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.2900	1.00	2.2915	2.3646	2.4316	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150

6*9M	6.25	0.25	6.15	7.28	6.95	12.50	0.00	12.50	-6.00
9*12M	4.25	0.25	3.95	4.74	5.79	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	12.25	0.50	12.55	14.25	16.70	23.00	3.50	23.00	-5.50
2*3Y	7.75	0.00	7.75	8.13	9.37	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	12.75	0.00	12.75	13.85	15.79	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	16.25	0.00	16.25	17.75	20.18	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	5.00	5.73	6.42	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.50	0.00	8.50	9.63	10.81	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.50	3.90	4.40	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.25	-0.25	4.35	4.44	4.88	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.75	-0.25	10.65	11.04	11.75	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.30	6.60	6.87	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	6.57	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.00	9.75	9.88	9.36	10.25	-5.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.822	0.10	1.838	1.866	1.860	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.927	0.10	1.949	1.997	2.014	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.021	0.40	2.040	2.083	2.122	2.230	1.577	2.808	1.225
3Y	2.097	0.70	2.111	2.152	2.203	2.315	1.617	2.895	1.200
4Y	2.227	0.80	2.237	2.298	2.372	2.502	1.755	3.110	1.232
5Y	2.345	1.30	2.349	2.405	2.472	2.602	1.805	3.198	1.217
7Y	2.474	0.90	2.475	2.535	2.598	2.728	2.024	3.350	1.270
10Y	2.555	0.70	2.552	2.614	2.692	2.815	2.115	3.580	1.355
20Y	2.550	-0.50	2.558	2.611	2.691	2.792	2.175	3.797	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.43	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.14	-0.03	108.19	108.22	108.08
LKTb	121.28	-0.06	121.45	121.50	121.10

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	-2.20	0.65	-3.83	-3.04	-0.81	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-6.20	1.40	-8.33	-8.28	-6.93	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-9.85	0.85	-11.46	-10.47	-10.30	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-9.70	0.55	-10.87	-9.29	-9.03	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-17.70	0.45	-18.43	-18.15	-19.52	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-26.00	-0.05	-26.13	-24.97	-25.12	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-34.65	0.10	-34.36	-33.50	-32.85	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-36.25	0.30	-35.76	-34.83	-35.37	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.00	1.50	-26.61	-24.65	-25.93	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1115.90 (-2.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-58.50	-0.25	1Y	1.2150	0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	1.50	-1.00		
-64.00	-1.50	1.5Y	1.2250	0.00	1.6600	0.8100	2*3Y	5.50	-1.00		
-69.25	-1.75	2Y	1.2300	-0.50	1.6950	0.8650	2*5Y	12.00	-1.00		
-71.50	-2.75	3Y	1.2850	-1.50	1.7550	0.9550	3*4Y	2.50	0.00		
-74.00	-2.75	4Y	1.3100	-1.50	1.8000	1.0150	3*5Y	6.50	0.00		
-73.50	-2.75	5Y	1.3500	-1.50	1.8500	1.0350	4*5Y	4.00	0.00		
-71.75	-2.50	7Y	1.4100	-1.50	1.8950	1.0400	5*7Y	6.00	0.00		
-57.25	-2.50	10Y	1.6200	-1.50	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	2.5366	-0.0162	2.5528	2.5324	2.5324	2.5892	1.1410	2.5892	0.3100
10Y	2.8223	-0.0119	2.8342	2.8312	2.8312	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	51.56	-2.02	53.58	49.24	46.74	53.58	-53.43	53.58	-246.80
10Y	26.73	-1.89	28.62	28.32	25.42	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	27.00	-0.25	27.25	26.75	28.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	53.40	0.30	53.10	50.80	51.20	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	28.57	0.43	28.14	29.88	29.88	124.46	28.14	242.00	28.14

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor	8Y 14 / 14.25			
06M	70 / 69.75								
09M									
01Y									
1.5Y	87								
02Y	90.75				SPRD	2*4Y 12.25			
03Y	0.25					3*5Y 8.25			
04Y									
05Y	7.75 / 08								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y CCS 20								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			65 건	-89	154	81	129	40	68
금 액			20,733 억원	-26,132	46,865	29,300	25,660	7,750	14,630

장중동향

국고채 금리, 미중 관세부과에도 큰 변동성 없이 금리 소폭 상승 마감.

무역전쟁 이슈는 이미 노출된 재료로 별다른 영향 없었음. 오히려 불확실성 해소로 받들이는 분위기.

IRS, 금리 전체적 상승 마감.

거래건수가 많지는 않았으나, 6M과 1.5Y를 중심으로 호가가 대치되며 국채선물 움직임에 대응하며 거래.

CRS, 2Y 이상 구간에서 금리 하락.