

IPS Daily Morning Brief

2018-07-11

종가 기준일 2018-07-10

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7000	0.00	1.6970	1.7136	1.7235	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7675	0.25	1.7600	1.7856	1.7934	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8075	0.25	1.8005	1.8314	1.8508	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8775	0.25	1.8660	1.9078	1.9435	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9325	0.25	1.9230	1.9696	2.0168	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0075	0.25	1.9995	2.0481	2.1100	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0550	0.25	2.0485	2.1030	2.1740	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.0900	0.00	2.0840	2.1406	2.2178	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1325	0.00	2.1270	2.1839	2.2665	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.1975	0.00	2.1915	2.2491	2.3350	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2375	0.00	2.2315	2.2891	2.3763	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2650	0.00	2.2590	2.3166	2.4007	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.2950	0.00	2.2890	2.3479	2.4289	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150

6*9M	6.75	0.25	6.30	7.20	6.99	12.50	0.00	12.50	-6.00
9*12M	4.00	0.00	4.05	4.58	5.74	10.50	0.00	10.50	-4.25
1*2Y	12.50	0.00	12.25	13.83	16.60	23.00	4.25	23.00	-5.50
2*3Y	7.50	0.00	7.65	7.85	9.33	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	12.25	0.00	12.55	13.34	15.73	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	15.75	-0.25	16.10	17.10	20.10	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.75	0.00	4.90	5.49	6.40	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.25	-0.25	8.45	9.25	10.78	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	-0.25	3.55	3.76	4.38	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.25	0.00	4.30	4.33	4.88	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.75	0.00	10.75	10.85	11.72	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.45	6.53	6.84	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.13	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	9.88	9.39	10.25	-3.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.817	-0.50	1.824	1.863	1.859	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.917	-0.90	1.929	1.987	2.012	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.007	-1.30	2.021	2.073	2.119	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.091	-1.40	2.099	2.140	2.200	2.315	1.617	2.890	1.200
4Y	2.220	-1.20	2.227	2.282	2.368	2.502	1.755	3.095	1.232
5Y	2.340	-1.50	2.344	2.391	2.470	2.602	1.805	3.198	1.217
7Y	2.467	-1.10	2.471	2.519	2.596	2.728	2.024	3.328	1.270
10Y	2.550	-0.70	2.552	2.597	2.689	2.815	2.115	3.567	1.355
20Y	2.547	-0.80	2.553	2.595	2.688	2.792	2.175	3.785	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.51	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.16	0.03	108.11	108.16	108.10
LKTb	121.30	0.02	121.15	121.36	121.15

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	-0.95	0.75	-2.37	-3.11	-0.83	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-3.95	1.15	-6.26	-7.93	-6.86	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-7.45	1.55	-9.80	-10.29	-10.21	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-8.35	1.65	-9.91	-9.19	-9.03	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-16.50	1.45	-17.85	-17.92	-19.38	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-25.00	1.50	-25.98	-24.99	-25.19	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.45	1.10	-34.42	-33.49	-32.91	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-35.25	0.70	-36.01	-34.82	-35.42	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-25.20	0.80	-26.40	-24.73	-25.91	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1116.00 (+3.80)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-54.25	1.75	1Y	1.2650	2.00	1.6200	0.7650	1*2Y	3.00	2.00		
-59.75	2.75	1.5Y	1.2800	3.00	1.6600	0.8100	2*3Y	5.50	0.00		
-63.75	3.75	2Y	1.2950	4.00	1.6950	0.8650	2*5Y	14.00	0.00		
-65.75	3.75	3Y	1.3500	4.00	1.7550	0.9550	3*4Y	4.00	0.00		
-66.50	3.75	4Y	1.3900	4.00	1.8000	1.0150	3*5Y	8.50	0.00		
-65.50	4.00	5Y	1.4350	4.00	1.8500	1.0350	4*5Y	4.50	0.00		
-64.25	3.50	7Y	1.4900	3.50	1.8950	1.0400	5*7Y	5.50	-0.50		
-49.75	3.50	10Y	1.7000	3.50	2.0500	1.0500	5*10Y	26.50	-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	2.5694	0.0082	2.5612	2.5366	2.5528	2.5892	1.1428	2.5892	0.3100
10Y	2.8570	-0.0037	2.8607	2.8223	2.8342	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	56.24	2.12	54.12	51.56	53.58	56.24	-53.43	56.24	-245.00
10Y	30.70	0.33	30.37	26.73	28.62	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	26.50	-0.25	26.75	27.00	27.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	54.30	0.60	53.70	53.40	53.10	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	28.76	-1.19	29.95	28.57	28.14	124.46	28.14	242.00	28.14

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	93.25	SPRD							
03Y									
04Y									
05Y	09 / 9.25 / 9.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	5y CCS 41								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	41 건	-4	45	65	154	81	129	40	
금 액	10,570 억원	130	10,440	20,733	46,865	29,300	25,660	7,750	

장종동향
국고채 금리, 금통위 대기하며 금리 소폭 하락.

IRS, 9Y~4Y 구간을 중심으로 금리 소폭 상승 마감.
장종 국채선물 움직임에 연동되며 역외 오픈가 꾸준히 유입. 금리 인상이 어렵다는 쪽에 베팅하는 모습.

CRS, 부채스왑 기대에 전구간 금리 상승.