IPS Daily Morning Brief

2018-07-16

종가 기준일 2018-07-13

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7150	0.25	1.7045	1.7099	1.7224	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7875	0.25	1.7725	1.7800	1.7929	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8400	0.50	1.8165	1.8248	1.8498	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9175	0.75	1.8880	1.8985	1.9415	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9700	1.00	1.9395	1.9575	2.0137	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0375	1.00	2.0105	2.0320	2.1060	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0775	1.00	2.0545	2.0831	2.1693	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.1100	1.00	2.0885	2.1190	2.2125	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1450	1.00	2.1275	2.1605	2.2610	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2125	1.25	2.1930	2.2250	2.3292	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2525	1.25	2.2330	2.2650	2.3703	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2800	1.25	2.2605	2.2925	2.3951	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3100	1.25	2.2905	2.3238	2.4236	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150
6*9M	7.25	0.00	6.80	7.01	7.05	12.50	0.25	12.50	-6.00
9*12M	5.25	0.25	4.40	4.48	5.69	10.50	0.50	10.50	-4.25
1*2Y	13.00	0.50	12.30	13.28	16.38	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	6.75	0.00	7.10	7.45	9.23	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	10.75	0.00	11.50	12.56	15.56	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	14.00	0.00	14.90	16.15	19.88	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.00	0.00	4.40	5.11	6.33	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.25	0.00	7.80	8.70	10.65	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.40	3.59	4.32	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.50	0.00	3.90	4.15	4.86	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.25	0.25	10.45	10.60	11.68	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	0.25	6.55	6.45	6.82	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.10	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.75	6.59	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.00	9.75	9.87	9.44	10.25	-2.50	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.856	0.50	1.830	1.856	1.859	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.955	1.00	1.927	1.971	2.009	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.037	0.70	2.014	2.056	2.114	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.102	1.20	2.087	2.120	2.195	2.315	1.617	2.890	1.200
4Y	2.227	1.20	2.214	2.256	2.360	2.502	1.755	3.089	1.232
5Y	2.340	1.00	2.331	2.366	2.464	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.471	0.90	2.460	2.494	2.590	2.728	2.024	3.320	1.270
10Y	2.557	1.00	2.544	2.573	2.684	2.815	2.115	3.567	1.355
20Y	2.547	1.20	2.539	2.571	2.681	2.792	2.185	3.785	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.49	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.12	-0.03	108.14	108.17	108.10
LKTB	121.26	-0.08	121.26	121.42	121.25

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	0.00	-1.31	-3.16	-0.88	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-3.75	-0.25	-3.94	-7.28	-6.73	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-6.70	0.30	-7.47	-9.88	-10.03	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-6.45	-0.20	-7.65	-8.84	-8.88	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-14.95	-0.20	-15.93	-17.31	-19.06	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-23.00	0.00	-24.29	-24.65	-25.16	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.60	0.10	-33.25	-33.32	-32.93	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-34.45	0.25	-35.06	-34.78	-35.44	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-23.70	0.05	-24.83	-24.74	-25.71	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-61.50	-4.00
-66.25	-4.25
-70.00	-4.50
-70.75	-4.50
-70.25	-5.00
-69.00	-5.50
-68.00	-5.50
-54.25	-5.75

CRS

USD/KRW 1123.50 (-2.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2250	-3.50	1.6200	0.7650	1*2Y	4.50	0.00
1.5Y	1.2550	-3.50	1.6600	0.8100	2*3Y	6.00	0.00
2Y	1.2700	-3.50	1.6950	0.8650	2*5Y	15.00	-1.00
3Y	1.3300	-3.50	1.7550	0.9550	3*4Y	4.50	-0.50
4Y	1.3750	-4.00	1.8000	1.0150	3*5Y	9.00	-1.00
5Y	1.4200	-4.50	1.8500	1.0350	4*5Y	4.50	-0.50
7Y	1.4650	-4.50	1.8950	1.0400	5*7Y	4.50	0.00
10Y	1.6700	-4.50	2.0500	1.0500	5*10Y	25.00	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	2.5863	-0.0202	2.6065	2.5859	2.5694	2.6065	1.1428	2.6065	0.3100
10Y	2.8295	-0.0156	2.8451	2.8478	2.8570	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	54.93	-2.72	57.65	60.89	56.24	60.89	-53.43	60.89	-245.00
10Y	27.25	-2.56	29.81	34.08	30.70	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	24.25	0.25	24.00	25.25	26.50	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	52.00	0.30	51.70	53.00	54.30	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	24.32	0.46	23.86	26.19	28.76	124.46	23.86	237.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	71.25 / 71.5	ODD Tenor	
09M	78.5 / 78.75		
01Y			
1.5Y	91.5		
02Y	96 / 96.5	SPRD	9*12m 05
03Y	2.75 / 3.5 / 3.75		1*1.5y 7.75
04Y			3*5y 7.25 / 7.5
05Y	10 / 11		10*12y 04
07Y	13 / 14.5		
10Y	20 / 20.25 / 21 / 21.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	112 건	2	110	104	41	45	65	154
금 액	33,415 억원	-7,113	40,528	37,835	10,570	10,440	20,733	46,865

장중동향

채권 금리 상승.
금통위 이후로 연내 또는 8월 금리인상 가능성에 대한 기대가 지속되며 약세를 유지.

IRS도 선물에 연동하며 레벨 상승.
활발한 장은 아니었지만 채권 가격의 움직임에 따라 변동하며 거래. 장 후반에 중장기쪽 으로 비디시한 움직임을 보이며 커브 스티프닝.

CRS는 하락 마감.