IPS Daily Morning Brief

2018-07-17

종가 기준일 2018-07-16

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7025	-1.25	1.7050	1.7088	1.7217	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7750	-1.25	1.7745	1.7783	1.7925	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8275	-1.25	1.8210	1.8231	1.8492	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9050	-1.25	1.8940	1.8964	1.9405	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9575	-1.25	1.9450	1.9549	2.0123	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0250	-1.25	2.0145	2.0285	2.1040	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0675	-1.00	2.0575	2.0786	2.1670	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.1000	-1.00	2.0905	2.1143	2.2100	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1350	-1.00	2.1280	2.1555	2.2583	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2025	-1.00	2.1940	2.2199	2.3265	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2425	-1.00	2.2340	2.2599	2.3674	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2700	-1.00	2.2615	2.2874	2.3924	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3000	-1.00	2.2915	2.3186	2.4210	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150

6*9M	7.25	0.00	6.95	6.95	7.08	12.50	0.25	12.50	-6.00
9*12M	5.25	0.00	4.65	4.49	5.67	10.50	0.50	10.50	-4.25
1*2Y	13.00	0.00	12.40	13.18	16.31	23.00	5.00	23.00	-5.50
2*3Y	6.75	0.00	6.95	7.36	9.18	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	11.00	0.25	11.25	12.38	15.47	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	14.25	0.25	14.55	15.94	19.77	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.25	0.25	4.30	5.01	6.29	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.50	0.25	7.60	8.58	10.59	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.30	3.56	4.30	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.50	0.00	3.75	4.12	4.84	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.25	0.00	10.35	10.56	11.65	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	0.00	6.60	6.44	6.81	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	9.46	10.25	-2.50	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.847	-0.90	1.835	1.854	1.858	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.950	-0.50	1.932	1.967	2.008	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.030	-0.70	2.016	2.052	2.112	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.087	-1.50	2.083	2.116	2.192	2.315	1.617	2.890	1.200
4Y	2.212	-1.50	2.210	2.249	2.356	2.502	1.755	3.089	1.232
5Y	2.326	-1.40	2.326	2.359	2.461	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.456	-1.50	2.456	2.488	2.588	2.728	2.024	3.320	1.270
10Y	2.542	-1.50	2.541	2.567	2.681	2.815	2.115	3.567	1.355
20Y	2.540	-0.70	2.536	2.566	2.677	2.792	2.185	3.785	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.50	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.17	0.05	108.14	108.21	108.11
LKTB	121.42	0.16	121.30	121.52	121.20

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	-1.95	-0.35	-1.36	-3.13	-0.92	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-4.50	-0.75	-3.82	-7.07	-6.71	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-7.25	-0.55	-7.12	-9.73	-9.98	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-6.20	0.25	-6.89	-8.74	-8.83	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-14.45	0.50	-15.23	-17.06	-18.95	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-22.60	0.40	-23.51	-24.50	-25.14	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.10	0.50	-32.76	-33.22	-32.92	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-33.95	0.50	-34.66	-34.74	-35.41	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.00	-0.30	-24.43	-24.75	-25.63	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-66.25	-4.75
-71.00	-4.75
-74.75	-4.75
-75.50	-4.75
-75.25	-5.00
-74.00	-5.00
-73.00	-5.00
-59.25	-5.00

CRS

USD/KRW 1129.20 (+5.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1650	-6.00	1.6200	0.7650	1*2Y	4.50	0.00
1.5Y	1.1950	-6.00	1.6600	0.8100	2*3Y	6.00	0.00
2Y	1.2100	-6.00	1.6950	0.8650	2*5Y	15.00	0.00
3Y	1.2700	-6.00	1.7550	0.9550	3*4Y	4.50	0.00
4Y	1.3150	-6.00	1.8000	1.0150	3*5Y	9.00	0.00
5Y	1.3600	-6.00	1.8500	1.0350	4*5Y	4.50	0.00
7Y	1.4050	-6.00	1.8950	1.0400	5*7Y	4.50	0.00
10Y	1.6100	-6.00	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	2.5988	0.0125	2.5863	2.6065	2.5859	2.6065	1.1428	2.6065	0.3100
10Y	2.8578	0.0283	2.8295	2.8451	2.8478	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	56.88	1.95	54.93	57.65	60.89	60.89	-53.43	60.89	-245.00
10Y	31.58	4.33	27.25	29.81	34.08	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	24.50	0.25	24.25	24.00	25.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	51.20	-0.80	52.00	51.70	53.00	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	25.90	1.58	24.32	23.86	26.19	124.46	23.86	237.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6y 11.5
06M			8y 15.25
09M	77.5		
01Y	83		
1.5Y			
02Y	97	SPRD	1*3y 19.75
03Y			4*5y 3.25
04Y	7		
05Y	10		7*10y 6.5 / 6.75
07Y			
10Y	20.75 / 21		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2y 21.5, 23.5 / 3y 27, 28.5		

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	39 건	-73	112	110	104	41	45	65
금 액	12,470 억원	-20,945	33,415	40,528	37,835	10,570	10,440	20,733

장중동향

채권 금리하락.

금통위 소수의견에 대한 채권약세분이 모두 반영되었다는 인식과 외국인의 매수세가 이어지면서 채권 강세. 10년물 입찰이 무난하게 끝나면서 장기물의 강세폭이 커지다가 일부 상승폭을 반납하며 마감.

IRS도 채권 강세와 연동해 레벨이 하락. 오전에는 거래없이 한산하다 오후들어 스프레드 거래를 중심으로 거래.

CRS는 전테너 +6bp 큰폭으로 하락.