

IPS Daily Morning Brief

2018-07-24

종가 기준일 2018-07-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7175	0.25	1.7140	1.7065	1.7199	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7700	0.25	1.7720	1.7711	1.7905	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8150	0.50	1.8170	1.8149	1.8456	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8950	0.50	1.8955	1.8876	1.9355	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9500	0.50	1.9500	1.9444	2.0054	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0150	0.75	2.0170	2.0163	2.0943	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0600	1.00	2.0610	2.0635	2.1549	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.1000	1.00	2.0985	2.0989	2.1972	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1400	1.50	2.1335	2.1383	2.2444	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2025	1.50	2.1970	2.2020	2.3120	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2425	1.50	2.2370	2.2420	2.3526	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2675	1.50	2.2625	2.2690	2.3780	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.2825	1.50	2.2790	2.2959	2.4062	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150

6*9M	5.25	0.00	5.80	6.46	7.06	12.50	0.25	12.50	-6.00
9*12M	4.50	0.25	4.50	4.38	5.51	10.50	0.75	10.50	-4.25
1*2Y	13.50	0.00	13.30	12.95	15.98	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	6.50	0.25	6.70	7.19	8.88	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	11.00	0.50	11.10	11.91	14.95	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	15.00	0.50	14.85	15.45	19.18	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.50	0.25	4.40	4.73	6.06	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.50	0.25	8.15	8.26	10.30	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.00	3.75	3.54	4.23	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.50	3.50	3.94	4.72	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.25	0.50	9.85	10.31	11.48	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.00	6.35	6.38	6.77	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.05	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.55	6.70	6.60	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	8.00	0.00	8.20	9.39	9.41	10.25	-2.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.822	0.00	1.829	1.841	1.856	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.930	0.00	1.936	1.947	2.001	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.012	0.50	2.018	2.033	2.103	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.077	0.20	2.083	2.100	2.181	2.315	1.617	2.890	1.200
4Y	2.197	0.50	2.204	2.226	2.340	2.502	1.755	3.089	1.232
5Y	2.320	1.00	2.322	2.340	2.447	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.449	1.30	2.449	2.468	2.573	2.728	2.024	3.320	1.270
10Y	2.540	1.80	2.536	2.550	2.665	2.815	2.115	3.567	1.355
20Y	2.542	1.20	2.538	2.550	2.662	2.792	2.197	3.785	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.49	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.21	-0.02	108.16	108.24	108.16
LKTb	121.47	-0.18	121.32	121.60	121.32

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	-0.70	0.50	-1.16	-2.57	-1.08	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-3.50	0.50	-4.07	-5.94	-6.55	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-6.20	0.00	-6.76	-8.88	-9.72	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-6.20	0.55	-6.64	-8.34	-8.69	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-13.70	0.50	-14.28	-16.23	-18.50	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-22.00	0.00	-22.33	-24.10	-25.01	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-30.90	0.20	-31.57	-32.96	-32.89	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-33.75	-0.30	-33.94	-34.79	-35.30	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-25.95	0.30	-25.92	-25.41	-25.57	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1131.40 (-2.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-61.00	-2.00	1Y	1.2050	-1.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-2.00	-0.50		
-69.00	-2.00	1.5Y	1.2050	-1.50	1.6600	0.8550	2*3Y	4.00	-0.50		
-76.50	-2.50	2Y	1.1850	-2.00	1.6950	0.8900	2*5Y	15.50	0.50		
-79.00	-3.25	3Y	1.2250	-2.50	1.7550	0.9700	3*4Y	5.00	0.00		
-78.50	-3.50	4Y	1.2750	-2.50	1.8000	1.0300	3*5Y	11.50	1.00		
-76.00	-2.50	5Y	1.3400	-1.50	1.8500	1.0500	4*5Y	6.50	1.00		
-75.00	-3.00	7Y	1.3900	-1.50	1.8950	1.0600	5*7Y	5.00	0.00		
-62.25	-3.00	10Y	1.5800	-1.50	2.0500	1.0900	5*10Y	24.00	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	2.6288	0.0335	2.5953	2.5867	2.6073	2.6288	1.1428	2.6288	0.3100
10Y	2.9593	0.0620	2.8973	2.8404	2.8716	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	61.68	2.85	58.83	56.57	58.73	61.68	-53.43	61.68	-245.00
10Y	41.93	4.40	37.53	30.04	34.16	41.93	-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	25.25	1.00	24.25	24.75	23.75	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	52.80	1.30	51.50	51.90	51.00	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	33.05	2.85	30.20	25.37	26.43	122.70	23.86	236.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	89								
02Y		SPRD	2*10Y 25.5						
03Y	1.75 / 1.5		4*9Y 12						
04Y									
05Y	10.5								
07Y									
10Y	21								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y CCS 21								
	2y CCS 18								
	3y CCS 22.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	21 건	-47	68	89	121	107	39	112	
금 액	4,906 억원	-9,500	14,406	27,218	33,052	32,035	12,470	33,415	

장중동향
국고채 금리, 상승 마감.
지난주 미국 채권금리가 도널드 트럼프 대통령의 금리인상 비판에도 상승한 영향을 받음.

IRS, 상승 마감. 커브 스티프닝.
전반적으로 거래가 많지 않은 가운데 글로벌 금리와 연동해서 약해지는 모습.

CRS, 전 구간 하락 마감.
전반적으로 1~3Y 구간에서 거래. 로컬오퍼와 포린비드가 대치하는 상황에서 굿넵간 거래.