

IPS Daily Morning Brief

2018-07-26

종가 기준일 2018-07-25

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7250	-0.25	1.7215	1.7079	1.7197	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7775	-0.25	1.7745	1.7705	1.7900	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8225	-0.50	1.8190	1.8141	1.8446	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9025	-0.50	1.8990	1.8874	1.9339	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9550	-0.75	1.9535	1.9430	2.0030	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0225	-1.00	2.0200	2.0144	2.0908	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0725	-1.00	2.0665	2.0610	2.1506	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.1150	-1.25	2.1075	2.0971	2.1928	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1525	-1.75	2.1455	2.1363	2.2396	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2150	-1.75	2.2080	2.1999	2.3071	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2550	-1.75	2.2480	2.2399	2.3475	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2800	-1.75	2.2730	2.2666	2.3730	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.2950	-1.75	2.2880	2.2918	2.4010	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150

6*9M	5.25	0.00	5.30	6.26	7.03	12.50	0.25	12.50	-6.00
9*12M	4.50	-0.25	4.45	4.36	5.46	10.50	0.75	10.50	-4.25
1*2Y	13.25	-0.25	13.45	12.89	15.84	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	6.75	-0.25	6.65	7.14	8.78	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	11.75	-0.25	11.30	11.80	14.76	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	16.00	-0.50	15.40	15.41	18.98	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	4.65	4.66	5.99	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	9.25	-0.25	8.75	8.28	10.21	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	4.25	-0.25	4.10	3.61	4.22	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.75	-0.50	3.80	3.91	4.68	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	-0.50	10.05	10.28	11.43	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.00	6.25	6.36	6.75	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.04	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.68	6.60	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	8.00	0.00	8.00	9.19	9.39	10.25	-2.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.831	0.40	1.827	1.836	1.856	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.932	0.20	1.932	1.941	1.999	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.017	-0.50	2.016	2.027	2.099	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.077	-0.80	2.081	2.095	2.176	2.315	1.617	2.888	1.200
4Y	2.200	-1.50	2.203	2.220	2.333	2.502	1.755	3.085	1.232
5Y	2.322	-1.80	2.324	2.335	2.442	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.452	-2.20	2.453	2.463	2.568	2.728	2.024	3.317	1.270
10Y	2.545	-2.50	2.543	2.547	2.659	2.815	2.115	3.562	1.355
20Y	2.540	-2.20	2.543	2.547	2.655	2.792	2.197	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	108.21	0.05	108.17	108.21	108.14
LKTb	121.42	0.26	121.25	121.47	121.11

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	-0.85	-0.90	-0.76	-2.14	-1.16	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-2.95	-0.70	-3.34	-5.38	-6.46	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-6.20	-0.25	-6.23	-8.43	-9.58	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-5.45	-0.20	-6.08	-8.03	-8.56	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-12.75	0.50	-13.63	-15.85	-18.26	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-20.70	0.55	-21.69	-23.79	-24.88	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.95	0.45	-30.75	-32.68	-32.80	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-33.00	0.75	-33.54	-34.66	-35.21	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.50	0.45	-25.52	-25.48	-25.45	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1126.30 (-8.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-59.75	0.50	1Y	1.2250	0.00	1.6200	0.8050	1*2Y	0.00	2.00		
-66.75	1.50	1.5Y	1.2350	1.00	1.6600	0.8750	2*3Y	4.00	0.00		
-73.00	2.75	2Y	1.2250	2.00	1.6950	0.9350	2*5Y	16.50	0.50		
-75.75	3.00	3Y	1.2650	2.00	1.7550	0.9850	3*4Y	5.50	0.00		
-75.25	3.00	4Y	1.3200	2.00	1.8000	1.0700	3*5Y	12.50	0.50		
-72.50	3.75	5Y	1.3900	2.50	1.8500	1.0800	4*5Y	7.00	0.50		
-71.25	4.25	7Y	1.4400	2.50	1.8950	1.0850	5*7Y	5.00	0.00		
-58.50	4.25	10Y	1.6300	2.50	2.0500	1.1250	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	2.6733	0.0402	2.6331	2.6288	2.5953	2.6733	1.1428	2.6733	0.3100
10Y	2.9769	0.0260	2.9509	2.9593	2.8973	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	65.63	4.52	61.11	61.68	58.83	65.63	-53.43	65.63	-245.00
10Y	43.19	5.10	38.09	41.93	37.53	43.19	-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	26.00	-1.00	27.00	25.25	24.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	52.80	-2.00	54.80	52.80	51.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	30.36	-1.42	31.78	33.05	30.20	122.70	23.86	236.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS				ODD Tenor						
06M										
09M										
01Y										
1.5Y	90.5									
02Y	96.5			SPRD	1*2Y	13.75				
03Y	3.25				1.5*3Y	12.25				
04Y	8.5 / 08 / 7.75				2*5Y	16 / 16.5				
05Y										
07Y										
10Y										
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6		
거래현황	77 건	5	72	21	68	89	121	107		
금 액	19,791 억원	3,251	16,540	4,906	14,406	27,218	33,052	32,035		

장중동향

국고채 금리, 장기물음 중심으로 금리 하락.

외인이 3년 국채선물을 중심으로 매수세를 확대한 가운데 주식시장이 악세를 나타낸 영향.

IRS, 금리 하락. 커브 플랫트닝.

휴가시즌을 맞아 한산한 분위기.

CRS, 1Y를 제외한 구간에서 금리 상승.