

IPS Daily Morning Brief

2018-07-27

종가 기준일 2018-07-26

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7275	0.25	1.7225	1.7089	1.7195	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7800	0.25	1.7750	1.7706	1.7896	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8250	0.25	1.8200	1.8144	1.8439	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9025	0.00	1.8995	1.8879	1.9328	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9575	0.25	1.9540	1.9431	2.0015	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0250	0.25	2.0205	2.0143	2.0887	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0750	0.25	2.0680	2.0609	2.1481	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.1175	0.25	2.1100	2.0974	2.1902	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1575	0.50	2.1490	2.1365	2.2368	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2200	0.50	2.2115	2.2003	2.3042	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2600	0.50	2.2515	2.2403	2.3445	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2850	0.50	2.2765	2.2669	2.3701	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3000	0.50	2.2915	2.2913	2.3979	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150

6*9M	5.25	0.00	5.25	6.18	7.02	12.50	0.25	12.50	-6.00
9*12M	4.50	0.00	4.50	4.38	5.43	10.50	0.75	10.50	-4.25
1*2Y	13.25	0.00	13.40	12.88	15.76	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	6.75	0.00	6.65	7.11	8.72	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	11.75	0.00	11.40	11.78	14.66	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	16.00	0.00	15.60	15.43	18.87	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	4.75	4.66	5.95	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	9.25	0.00	8.95	8.31	10.15	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.00	4.20	3.65	4.21	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.25	3.90	3.91	4.66	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.25	0.25	10.15	10.29	11.40	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.00	6.25	6.38	6.74	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.03	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.66	6.60	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	8.00	0.00	8.00	9.10	9.37	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	0.00	1.827	1.834	1.856	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.931	-0.10	1.931	1.939	1.997	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.010	-0.70	2.014	2.025	2.096	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.067	-1.00	2.076	2.092	2.173	2.315	1.617	2.888	1.200
4Y	2.191	-0.90	2.199	2.217	2.329	2.502	1.755	3.085	1.232
5Y	2.320	-0.20	2.322	2.333	2.438	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.452	0.00	2.453	2.462	2.564	2.728	2.024	3.317	1.270
10Y	2.550	0.50	2.545	2.546	2.656	2.815	2.115	3.562	1.355
20Y	2.542	0.20	2.543	2.546	2.652	2.792	2.197	3.785	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.51	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.22	0.01	108.18	108.23	108.16
LKTb	121.35	-0.07	121.25	121.41	121.22

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	-0.60	0.25	-0.66	-1.96	-1.22	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-2.85	0.10	-3.11	-5.11	-6.42	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-5.25	0.95	-5.96	-8.17	-9.48	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-4.20	1.25	-5.57	-7.81	-8.46	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-11.60	1.15	-13.10	-15.59	-18.11	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-20.25	0.45	-21.24	-23.61	-24.78	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.45	0.50	-30.36	-32.51	-32.74	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-33.00	0.00	-33.39	-34.58	-35.16	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.20	0.30	-25.17	-25.44	-25.39	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1119.30 (-7.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-58.50	1.25	1Y	1.2400	1.50	1.6200	0.8050	1*2Y	-0.50	-0.50		
-65.75	1.00	1.5Y	1.2450	1.00	1.6600	0.9000	2*3Y	4.00	0.00		
-72.25	0.75	2Y	1.2350	1.00	1.6950	0.9650	2*5Y	16.00	-0.50		
-75.00	0.75	3Y	1.2750	1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	5.00	-0.50		
-75.00	0.25	4Y	1.3250	0.50	1.8000	1.0700	3*5Y	12.00	-0.50		
-72.25	0.25	5Y	1.3950	0.50	1.8500	1.0800	4*5Y	7.00	0.00		
-71.25	0.00	7Y	1.4450	0.50	1.8950	1.1050	5*7Y	5.00	0.00		
-58.50	0.00	10Y	1.6350	0.50	2.0500	1.2200	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	2.6813	0.0080	2.6733	2.6331	2.6288	2.6813	1.1686	2.6813	0.3100
10Y	2.9807	0.0038	2.9769	2.9509	2.9593	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	67.13	1.5	65.63	61.11	61.68	67.13	-53.43	67.13	-245.00
10Y	43.07	-0.12	43.19	38.09	41.93	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	26.25	0.25	26.00	27.00	25.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	54.00	1.20	52.80	54.80	52.80	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	29.94	-0.42	30.36	31.78	33.05	122.70	23.86	236.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6Y 14.5						
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	91.25								
02Y		SPRD	1.5*3Y 12.25						
03Y	3		1.5*5Y 21.75						
04Y			2*5Y 16.25						
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	82 건	5	77	72	21	68	89	121	
금 액	20,877 억원	1,086	19,791	16,540	4,906	14,406	27,218	33,052	

장종동향
국고채 금리, 단기물 금리는 하락했지만, 장기물 금리는 상승.
국채선물은 미 국채금리가 상승한 영향을 반영해 하락 출발했으나, 장 막판으로 가면서 단기 국채선물은 강보합세로 전환했고, 장기 국채선물도 약보합 수준으로 가격 하락폭을 축소했음.

IRS, 금리 전 구간 상승.
조용한 장세속 국채선물과 연동되며 제한적인 모습을 보임.

CRS, 전 구간에서 금리 상승.