

IPS Daily Morning Brief

2018-07-31

종가 기준일 2018-07-30

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7575	0.00	1.7390	1.7139	1.7195	1.7575	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.8150	0.25	1.7930	1.7749	1.7895	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8650	0.25	1.8405	1.8198	1.8434	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9450	0.50	1.9195	1.8939	1.9312	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	2.0050	0.75	1.9755	1.9490	1.9993	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0700	0.75	2.0425	2.0194	2.0852	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.1175	0.75	2.0915	2.0659	2.1438	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.1525	0.50	2.1320	2.1025	2.1855	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1875	0.50	2.1700	2.1411	2.2316	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2450	0.00	2.2315	2.2049	2.2988	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2850	0.00	2.2715	2.2449	2.3390	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.3100	0.00	2.2965	2.2713	2.3648	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3250	0.00	2.3115	2.2941	2.3923	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150

6*9M	5.75	0.25	5.40	6.10	7.00	12.50	1.00	12.50	-6.00
9*12M	5.00	0.00	4.75	4.49	5.39	10.50	0.75	10.50	-4.25
1*2Y	14.00	0.50	13.50	12.93	15.59	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	6.50	0.00	6.70	7.04	8.59	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	11.25	0.00	11.60	11.69	14.45	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	14.75	-0.25	15.65	15.35	18.62	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.75	0.00	4.90	4.65	5.86	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.25	-0.25	8.95	8.31	10.03	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	-0.25	4.05	3.66	4.16	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.50	0.00	3.80	3.86	4.62	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.25	-0.50	9.95	10.24	11.34	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	5.75	-0.50	6.15	6.38	6.72	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.01	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.64	6.60	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	8.00	0.00	8.00	8.92	9.35	10.25	-2.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.875	1.80	1.844	1.835	1.857	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.981	2.20	1.947	1.939	1.994	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.060	1.50	2.031	2.024	2.092	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.127	1.70	2.093	2.092	2.168	2.315	1.617	2.888	1.200
4Y	2.244	1.60	2.216	2.216	2.322	2.502	1.755	3.085	1.232
5Y	2.367	1.20	2.341	2.335	2.432	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.482	0.60	2.467	2.463	2.558	2.728	2.024	3.317	1.270
10Y	2.571	0.10	2.561	2.549	2.649	2.815	2.115	3.562	1.355
20Y	2.552	0.50	2.549	2.546	2.645	2.792	2.197	3.785	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.50	5.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.04	-0.03	108.04	108.06	108.00
LKTb	121.13	-0.02	121.08	121.25	121.07

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	-1.00	-1.55	-0.37	-1.48	-1.34	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-3.60	-1.70	-2.71	-4.47	-6.30	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-5.50	-0.75	-5.53	-7.53	-9.26	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-5.70	-0.95	-5.07	-7.26	-8.27	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-12.65	-0.85	-12.41	-15.04	-17.81	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-21.45	-0.70	-20.88	-23.25	-24.61	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.45	-0.10	-29.72	-32.15	-32.63	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-32.60	-0.10	-32.97	-34.39	-35.05	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-22.70	-0.50	-23.71	-25.14	-25.24	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1120.20 (+2.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-53.00	3.25	1Y	1.3350	3.50	1.6200	0.8050	1*2Y	1.50	-0.50	
-60.00	2.50	1.5Y	1.3450	3.00	1.6600	0.9050	2*3Y	4.00	0.00	
-65.50	2.25	2Y	1.3500	3.00	1.6950	0.9750	2*5Y	16.00	0.00	
-68.00	2.25	3Y	1.3900	3.00	1.7550	0.9850	3*4Y	5.00	0.00	
-67.75	2.25	4Y	1.4400	3.00	1.8000	1.0700	3*5Y	12.00	0.00	
-64.25	2.50	5Y	1.5100	3.00	1.8500	1.0800	4*5Y	7.00	0.00	
-62.75	2.50	7Y	1.5600	3.00	1.8950	1.1050	5*7Y	5.00	0.00	
-49.50	3.00	10Y	1.7500	3.00	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	2.6654	0.0081	2.6573	2.6813	2.6733	2.6813	1.1686	2.6813	0.3100
10Y	2.9752	0.0196	2.9556	2.9807	2.9769	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	60.54	-0.69	61.23	67.13	65.63	67.13	-53.43	67.13	-245.00
10Y	40.42	1.86	38.56	43.07	43.19	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	24.00	-0.75	24.75	26.25	26.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	51.10	-1.40	52.50	54.00	52.80	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	30.98	1.15	29.83	29.94	30.36	122.70	23.86	236.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS		ODD Tenor								
06M										
09M	81.5 / 81.75									
01Y	86.75									
1.5Y	94.5									
02Y	0.75		SPRD	1*2Y 14						
03Y	6.25 / 7.5 / 07 / 7.25									
04Y	11.75									
05Y	15.25									
07Y										
10Y	24.5									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	4y CCS 40.5									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6		
거래현황	76 건	-30	106	82	77	72	21	68		
금 액	35,595 억원	-1,849	37,444	20,877	19,791	16,540	4,906	14,406		

장중동향
국고채 금리, 이주열 총재가 최근 잠재수준의 성장세와 2% 물가가 전제된다면 완화된 금리 수준을 조정할 필요가 있다고 발언한 여파로 금리 상승 마감.

IRS, 10Y 아래 구간에서 금리 상승.
지난주 이주열 한은 총재의 매파 발언으로 단기구간에서 비드 출현.

CRS, 전반적 금리 상승.
부채물량에 시장에서 소화되자 금리 상승 압력으로 작용.