

IPS Daily Morning Brief

2018-08-01

종가 기준일 2018-07-31

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7550	-0.25	1.7445	1.7165	1.7196	1.7575	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.8125	-0.25	1.7995	1.7771	1.7893	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8625	-0.25	1.8475	1.8225	1.8429	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9425	-0.25	1.9265	1.8970	1.9300	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	2.0025	-0.25	1.9835	1.9519	1.9979	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0675	-0.25	2.0495	2.0214	2.0832	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.1125	-0.50	2.0975	2.0675	2.1415	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.1450	-0.75	2.1355	2.1040	2.1828	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1775	-1.00	2.1715	2.1419	2.2288	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2350	-1.00	2.2320	2.2054	2.2959	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2750	-1.00	2.2720	2.2454	2.3359	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2975	-1.25	2.2965	2.2715	2.3618	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3125	-1.25	2.3115	2.2936	2.3892	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150

6*9M	5.75	0.00	5.50	6.06	6.97	12.50	1.00	12.50	-6.00
9*12M	5.00	0.00	4.80	4.54	5.36	10.50	1.00	10.50	-4.25
1*2Y	14.00	0.00	13.60	12.94	15.50	23.00	5.75	23.00	-5.50
2*3Y	6.50	0.00	6.60	6.95	8.53	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	11.00	-0.25	11.40	11.56	14.35	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	14.25	-0.50	15.20	15.21	18.49	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	4.50	-0.25	4.80	4.61	5.83	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	7.75	-0.50	8.60	8.26	9.96	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.25	-0.25	3.80	3.65	4.14	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	3.25	-0.25	3.60	3.79	4.59	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	9.00	-0.25	9.65	10.14	11.30	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	5.75	0.00	6.05	6.35	6.71	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.00	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.25	-0.25	6.45	6.61	6.59	6.75	2.25	15.00	-0.75
10*20Y	7.75	-0.25	7.95	8.83	9.33	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	0.00	1.854	1.836	1.857	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.988	0.70	1.958	1.939	1.993	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.062	0.20	2.039	2.024	2.089	2.230	1.577	2.807	1.225
3Y	2.125	-0.20	2.101	2.091	2.165	2.315	1.617	2.888	1.200
4Y	2.235	-0.90	2.220	2.215	2.318	2.502	1.755	3.085	1.232
5Y	2.362	-0.50	2.345	2.334	2.428	2.602	1.805	3.185	1.217
7Y	2.480	-0.20	2.468	2.461	2.554	2.728	2.024	3.317	1.270
10Y	2.570	-0.10	2.561	2.548	2.646	2.815	2.115	3.562	1.355
20Y	2.545	-0.70	2.545	2.544	2.641	2.792	2.197	3.785	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.52	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.03	-0.01	108.04	108.10	107.96
LKTb	121.16	0.03	121.08	121.48	120.80

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	-1.25	-0.25	-0.63	-1.33	-1.37	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-4.55	-0.95	-3.17	-4.25	-6.25	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-5.95	-0.45	-5.53	-7.23	-9.16	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-5.75	-0.05	-5.17	-7.00	-8.17	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-12.25	0.40	-12.21	-14.73	-17.65	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-21.70	-0.25	-20.97	-23.01	-24.52	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-30.25	-0.80	-29.69	-31.96	-32.57	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-33.50	-0.90	-32.92	-34.31	-35.01	-24.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-23.25	-0.55	-23.37	-25.02	-25.18	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1118.70 (-1.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-55.25	-2.25	1Y	1.3100	-2.50	1.6200	0.8050	1*2Y	2.00	0.50		
-62.25	-2.25	1.5Y	1.3200	-2.50	1.6600	0.8950	2*3Y	4.50	0.50		
-67.25	-1.75	2Y	1.3300	-2.00	1.6950	0.9600	2*5Y	16.50	0.50		
-69.25	-1.25	3Y	1.3750	-1.50	1.7550	0.9850	3*4Y	5.00	0.00		
-68.75	-1.00	4Y	1.4250	-1.50	1.8000	1.0700	3*5Y	12.00	0.00		
-65.00	-0.75	5Y	1.4950	-1.50	1.8500	1.0800	4*5Y	7.00	0.00		
-63.75	-1.00	7Y	1.5400	-2.00	1.8950	1.1050	5*7Y	4.50	-0.50		
-50.50	-1.00	10Y	1.7300	-2.00	2.0500	1.2200	5*10Y	23.50	-0.50		

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	2.6856	0.0202	2.6654	2.6573	2.6813	2.6856	1.1686	2.6856	0.3100
10Y	2.9631	-0.0121	2.9752	2.9556	2.9807	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	62.36	1.82	60.54	61.23	67.13	67.13	-53.43	67.13	-245.00
10Y	39.31	-1.11	40.42	38.56	43.07	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	23.25	-0.75	24.00	24.75	26.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	50.80	-0.30	51.10	52.50	54.00	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	27.75	-3.23	30.98	29.83	29.94	122.70	23.86	236.00	23.86

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	95								
02Y		SPRD	5*10Y 9.25 / 09 / 8.75						
03Y	7.25 / 07		2*3Y 6.5						
04Y			2*4Y 11						
05Y			4*10Y 11.75						
07Y									
10Y	23.5								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y CCS 31								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	61 건		-15	76	106	82	77	72	21
금 액	15,180 억원		-20,415	35,595	37,444	20,877	19,791	16,540	4,906

장중동향

국고채 금리, 소폭 하락 마감.

국채선물은 약보합세로 출발. 일본은행(BOJ)이 정책 기조를 유지하겠다고 전하면서 시장은 강세로 돌아섰으나 장 막판 금통위 의 사례 발표를 앞두고 강보합세로 마감.

IRS, 하락 마감. 커브 플랫트닝.

일본은행(BOJ)이 비둘기 기조로 해석되는 회의 결과를 발표하자 강세가 펼쳐짐. 외국인도 국채선물을 모두 순매수해 강세 압력을 가함.