

IPS Daily Morning Brief

2018-06-04

종가 기준일 2018-06-01

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7200	0.25	1.7045	1.7259	1.7230	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7900	0.75	1.7760	1.7994	1.7871	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8450	1.00	1.8345	1.8660	1.8482	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9300	0.25	1.9290	1.9729	1.9509	2.0250	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.0075	0.25	2.0075	2.0543	2.0280	2.1150	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.1025	0.25	2.1040	2.1561	2.1284	2.2225	1.5050	2.9250	1.1550
4Y	2.1725	0.50	2.1725	2.2244	2.1943	2.2950	1.5625	3.0150	1.1575
5Y	2.2225	0.75	2.2215	2.2704	2.2389	2.3400	1.6125	3.0950	1.1575
7Y	2.2775	1.00	2.2755	2.3234	2.2886	2.3950	1.6825	3.2350	1.1675
10Y	2.3450	1.00	2.3440	2.3935	2.3573	2.4850	1.7725	3.3775	1.2125
12Y	2.3850	1.00	2.3840	2.4341	2.4009	2.5225	1.8000	3.4125	1.2150
15Y	2.4125	1.00	2.4105	2.4574	2.4220	2.5400	1.7900	3.4375	1.2150
20Y	2.4425	1.00	2.4405	2.4855	2.4453	2.5600	1.7000	3.5725	1.2150

6*9M	7.00	0.50	7.15	7.35	6.40	12.50	-1.00	12.50	-6.00
9*12M	5.50	0.25	5.85	6.66	6.11	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	16.25	-0.75	17.30	18.83	17.98	23.00	1.00	23.00	-5.50
2*3Y	9.50	0.00	9.65	10.19	10.04	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	16.50	0.25	16.50	17.01	16.63	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	21.50	0.50	21.40	21.61	21.09	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	7.00	0.25	6.85	6.82	6.59	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	12.00	0.50	11.75	11.43	11.05	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	5.00	0.25	4.90	4.60	4.46	6.25	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	5.50	0.25	5.40	5.30	4.97	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	12.25	0.25	12.25	12.31	11.84	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	0.00	6.85	7.01	6.88	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.06	4.35	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.65	6.39	6.46	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.00	9.65	9.20	8.80	10.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.840	-1.30	1.855	1.868	1.873	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.971	-0.80	1.984	2.038	2.029	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.105	-0.50	2.109	2.154	2.142	2.230	1.560	2.818	1.225
3Y	2.187	-0.80	2.193	2.245	2.228	2.315	1.600	2.913	1.200
4Y	2.376	-0.10	2.377	2.423	2.408	2.502	1.722	3.160	1.232
5Y	2.482	0.50	2.484	2.527	2.483	2.602	1.770	3.225	1.217
7Y	2.602	0.60	2.601	2.649	2.607	2.728	1.965	3.418	1.270
10Y	2.702	0.70	2.700	2.752	2.702	2.815	2.047	3.615	1.355
20Y	2.690	-0.50	2.704	2.749	2.704	2.792	2.110	3.840	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.45	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.89	0.01	107.90	107.96	107.87
LKTb	119.97	-0.07	120.12	120.18	119.96

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	0.50	2.30	-2.05	-0.21	-2.44	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-4.10	1.05	-5.50	-6.51	-7.82	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-9.75	0.75	-10.15	-9.95	-11.38	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-8.45	1.05	-8.86	-8.85	-9.94	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-20.35	0.60	-20.41	-19.88	-21.35	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-25.95	0.25	-26.23	-25.70	-24.36	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.45	0.40	-32.53	-32.57	-31.88	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-35.70	0.30	-35.62	-35.89	-34.43	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.75	1.50	-26.33	-26.32	-25.90	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1075.00 (-2.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-84.50	-0.50	1Y	1.0000	0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	9.50	0.00	
-89.00	-0.25	1.5Y	1.0400	0.00	1.6600	0.8100	2*3Y	3.50	0.00	
-91.25	0.25	2Y	1.0950	0.50	1.6950	0.8650	2*5Y	10.00	-0.50	
-97.25	0.25	3Y	1.1300	0.50	1.7550	0.9550	3*4Y	3.50	0.00	
-100.75	0.00	4Y	1.1650	0.50	1.8000	1.0150	3*5Y	6.50	-0.50	
-102.75	-0.75	5Y	1.1950	0.00	1.8500	1.0350	4*5Y	3.00	-0.50	
-94.25	-1.00	7Y	1.3350	0.00	1.8950	1.0400	5*7Y	14.00	0.00	
-75.50	-1.00	10Y	1.5900	0.00	2.0500	1.0500	5*10Y	39.50	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	2.4797	0.0482	2.4315	2.4074	2.3274	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.9031	0.0427	2.8604	2.8568	2.7765	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	37.47	5.32	32.15	29.74	22.24	42.26	-53.43	42.26	-251.80
10Y	20.11	3.57	16.54	16.18	8.95	40.30	-24.46	47.40	-98.50

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	33.75	0.75	33.00	33.50	33.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	59.70	1.20	58.50	58.50	58.20	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	42.34	-0.55	42.89	44.94	44.91	128.30	41.06	243.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6Y 24.25						
06M									
09M									
01Y	83.5								
1.5Y									
02Y	99.75 / 00	SPRD	6*9M 6.5 / 6.75						
03Y	9.5 / 9.75 / 9.25								
04Y									
05Y	20.75 / 21								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	72 건	-67	139	92	101	77	76	133	
금 액	20,675 억원	-28,215	48,890	24,433	50,708	27,843	24,820	51,770	

장중동향

국고채 금리, 보험권 혼조세 마감.

장 막판 유럽시장이 개장하면서 독일 국채 금리 상승 & 아시아 시장 미국 금리 상승으로 장기물 중심 금리 상승.

IRS, 전반적으로 비디쉬한 분위기 속 금리 상승 마감.

단기물,3Y,5Y를 중심으로 거래.

CRS, 1Y~4Y 구간을 중심으로 금리 소폭 상승 마감.