

IPS Daily Morning Brief

2018-06-07

종가 기준일 2018-06-06

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7200	-0.75	1.7225	1.7218	1.7227	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7925	-0.75	1.7930	1.7955	1.7873	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8475	-0.75	1.8475	1.8605	1.8481	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9350	-0.75	1.9355	1.9631	1.9491	2.0250	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.0150	-0.75	2.0145	2.0451	2.0258	2.1150	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.1150	-0.50	2.1115	2.1461	2.1258	2.2225	1.5050	2.9250	1.1550
4Y	2.1825	-1.00	2.1815	2.2145	2.1918	2.2950	1.5625	3.0150	1.1575
5Y	2.2325	-1.25	2.2320	2.2611	2.2368	2.3400	1.6125	3.0950	1.1575
7Y	2.2850	-1.75	2.2870	2.3154	2.2867	2.3950	1.6825	3.2175	1.1675
10Y	2.3550	-1.75	2.3560	2.3864	2.3551	2.4850	1.7725	3.3450	1.2125
12Y	2.3950	-1.75	2.3960	2.4264	2.3984	2.5225	1.8000	3.3850	1.2150
15Y	2.4225	-1.75	2.4235	2.4508	2.4199	2.5400	1.7900	3.4125	1.2150
20Y	2.4525	-1.75	2.4535	2.4800	2.4438	2.5600	1.7200	3.5400	1.2150

6*9M	7.25	0.00	7.05	7.38	6.46	12.50	-0.75	12.50	-6.00
9*12M	5.50	0.00	5.45	6.50	6.08	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	16.75	0.00	16.70	18.46	17.78	23.00	1.00	23.00	-5.50
2*3Y	10.00	0.25	9.70	10.10	10.00	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	16.75	-0.25	16.70	16.94	16.60	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	21.75	-0.50	21.75	21.60	21.09	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	6.75	-0.50	7.00	6.84	6.60	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	11.75	-0.75	12.05	11.50	11.09	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	5.00	-0.25	5.05	4.66	4.50	6.25	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	5.25	-0.50	5.50	5.43	4.99	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	12.25	-0.50	12.40	12.53	11.84	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.00	6.90	7.10	6.85	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.33	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.44	6.48	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.00	9.75	9.36	8.86	10.00	-6.25	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.845	0.50	1.844	1.863	1.868	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.010	3.00	1.984	2.025	2.024	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.132	1.20	2.117	2.143	2.138	2.230	1.560	2.818	1.225
3Y	2.202	-0.80	2.201	2.232	2.224	2.315	1.600	2.913	1.200
4Y	2.391	-0.60	2.388	2.413	2.403	2.502	1.722	3.125	1.232
5Y	2.500	-0.40	2.493	2.518	2.481	2.602	1.770	3.208	1.217
7Y	2.618	-1.20	2.615	2.640	2.606	2.728	1.966	3.375	1.270
10Y	2.717	-1.80	2.717	2.745	2.701	2.815	2.057	3.585	1.355
20Y	2.709	-1.60	2.709	2.741	2.703	2.792	2.110	3.799	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.86	0.03	107.82	107.87	107.79
LKTb	119.86	0.21	119.60	119.94	119.59

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	0.25	-1.25	0.39	-0.26	-2.01	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.50	-3.75	-4.85	-6.22	-7.53	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-11.70	-1.95	-10.29	-9.74	-11.20	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-8.70	0.30	-8.93	-8.55	-9.80	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-20.85	-0.40	-20.61	-19.81	-21.15	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-26.75	-0.85	-26.14	-25.64	-24.41	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.30	-0.55	-32.82	-32.51	-31.89	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-36.20	0.05	-36.08	-35.84	-34.60	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-25.65	-0.15	-25.53	-26.13	-25.94	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1070.70 (-1.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-77.75	4.75	1Y	1.0700	4.00	1.6200	0.7650	1*2Y	8.50	-0.50	
-83.50	4.25	1.5Y	1.1000	3.50	1.6600	0.8100	2*3Y	3.50	0.00	
-86.00	4.25	2Y	1.1550	3.50	1.6950	0.8650	2*5Y	9.00	-1.00	
-92.50	4.00	3Y	1.1900	3.50	1.7550	0.9550	3*4Y	3.00	-0.50	
-96.25	4.00	4Y	1.2200	3.00	1.8000	1.0150	3*5Y	5.50	-1.00	
-98.75	3.75	5Y	1.2450	2.50	1.8500	1.0350	4*5Y	2.50	-0.50	
-90.50	3.75	7Y	1.3800	2.00	1.8950	1.0400	5*7Y	13.50	-0.50	
-73.50	2.25	10Y	1.6200	0.50	2.0500	1.0500	5*10Y	37.50	-2.00	

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	2.5283	0.0325	2.4958	2.5202	2.4797	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.9717	0.0476	2.9241	2.9451	2.9031	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	39.63	2.05	37.58	40.02	37.47	42.26	-53.43	42.26	-251.80
10Y	25.47	6.56	18.91	21.01	20.11	38.30	-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	34.00	-1.00	35.00	35.00	33.75	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	58.50	-3.00	61.50	61.50	59.70	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	44.34	1.51	42.83	42.49	42.34	128.30	41.06	243.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	80									
09M										
01Y	85.25									
1.5Y										
02Y					SPRD	1*1.5y	8.5			
03Y	12.25					1.5*2y	8.25			
04Y						5*7y	5.5			
05Y	24									
07Y	29.5									
10Y	37									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	50 건		9	41	41	72	139	92	101	
금 액	12,690 억원		2,370	10,320	10,320	20,675	48,890	24,433	50,708	

장중동향
채권 강보합 마감.
전일 미국채권이 약세를 보임에 따라 하락세를 보이던 채권은 국내외 이벤트 경계로 뚜렷한 방향성을 보이지 못함. 장 후반 매수세가 유입되며 강보합 마감.

IRS는 장기물을 중심으로 레벨 하락. 커브 플랫트닝.
전반적으로 오퍼리시한 분위기에 단기물보다 중장기물 거래가 상대적으로 많음.

CRS는 전테너 상승마감.