

IPS Daily Morning Brief

2018-06-11

종가 기준일 2018-06-08

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7150	-0.75	1.7225	1.7191	1.7227	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7850	-1.25	1.7950	1.7920	1.7877	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8425	-1.25	1.8510	1.8556	1.8484	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9325	-1.50	1.9400	1.9563	1.9486	2.0250	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.0075	-2.25	2.0195	2.0386	2.0250	2.1150	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.1100	-2.50	2.1200	2.1403	2.1250	2.2225	1.5050	2.9250	1.1550
4Y	2.1800	-2.50	2.1905	2.2089	2.1910	2.2950	1.5625	3.0150	1.1575
5Y	2.2275	-3.00	2.2415	2.2560	2.2361	2.3400	1.6125	3.0950	1.1575
7Y	2.2800	-3.25	2.2965	2.3109	2.2862	2.3950	1.6825	3.2175	1.1675
10Y	2.3525	-3.25	2.3675	2.3821	2.3546	2.4850	1.7725	3.3450	1.2125
12Y	2.3925	-3.25	2.4075	2.4221	2.3977	2.5225	1.8000	3.3850	1.2150
15Y	2.4200	-3.25	2.4350	2.4473	2.4194	2.5400	1.7900	3.4125	1.2150
20Y	2.4500	-3.25	2.4650	2.4773	2.4436	2.5600	1.7200	3.5400	1.2150

6*9M	7.00	-0.50	7.25	7.29	6.50	12.50	-0.75	12.50	-6.00
9*12M	5.75	0.00	5.60	6.36	6.07	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	16.50	-1.00	16.85	18.30	17.66	23.00	1.00	23.00	-5.50
2*3Y	10.25	-0.25	10.05	10.16	10.00	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	17.25	-0.25	17.10	17.03	16.59	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	22.00	-0.75	22.20	21.74	21.10	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	7.00	0.00	7.05	6.86	6.60	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	11.75	-0.50	12.15	11.58	11.11	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	4.75	-0.50	5.10	4.71	4.51	6.25	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	5.25	-0.25	5.50	5.49	5.01	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	12.50	-0.25	12.60	12.61	11.85	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.25	0.00	7.10	7.13	6.84	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.31	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.51	6.48	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.00	9.75	9.51	8.90	10.00	-6.25	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.841	-0.90	1.843	1.857	1.865	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.011	-0.90	2.000	2.018	2.023	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.115	-2.50	2.125	2.137	2.136	2.230	1.567	2.818	1.225
3Y	2.180	-3.20	2.203	2.223	2.221	2.315	1.617	2.913	1.200
4Y	2.372	-4.00	2.394	2.406	2.401	2.502	1.722	3.125	1.232
5Y	2.472	-5.00	2.500	2.512	2.481	2.602	1.782	3.208	1.217
7Y	2.601	-4.50	2.625	2.635	2.606	2.728	1.966	3.375	1.270
10Y	2.706	-4.60	2.729	2.740	2.702	2.815	2.057	3.585	1.355
20Y	2.690	-4.20	2.716	2.736	2.704	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	107.94	0.14	107.84	107.94	107.80
LKTB	119.99	0.47	119.75	119.99	119.54

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.15	-0.35	0.78	-0.18	-1.71	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.85	-0.60	-6.02	-6.16	-7.40	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.75	0.25	-10.59	-9.80	-11.08	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-7.00	0.70	-8.28	-8.31	-9.64	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-19.20	1.50	-20.33	-19.76	-21.02	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-24.45	2.00	-25.89	-25.55	-24.48	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.10	1.25	-32.85	-32.41	-31.94	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-35.35	1.35	-36.15	-35.75	-34.72	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.00	0.95	-25.12	-25.89	-26.06	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1075.90 (+6.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-76.25	-0.75	1Y	1.0800	-2.00	1.6200	0.7650	1*2Y	8.00	-0.50	
-82.75	-1.00	1.5Y	1.1050	-2.50	1.6600	0.8100	2*3Y	3.50	0.00	
-84.75	-0.25	2Y	1.1600	-2.50	1.6950	0.8650	2*5Y	8.50	0.00	
-91.50	0.00	3Y	1.1950	-2.50	1.7550	0.9550	3*4Y	2.50	0.00	
-96.00	0.00	4Y	1.2200	-2.50	1.8000	1.0150	3*5Y	5.00	0.00	
-98.25	0.50	5Y	1.2450	-2.50	1.8500	1.0350	4*5Y	2.50	0.00	
-93.00	-0.25	7Y	1.3500	-3.50	1.8950	1.0400	5*7Y	10.50	-1.00	
-76.25	-0.25	10Y	1.5900	-3.50	2.0500	1.0500	5*10Y	34.50	-1.00	

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	2.5039	0.0163	2.4876	2.5283	2.4958	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.9501	0.0275	2.9226	2.9717	2.9241	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	38.89	4.13	34.76	39.63	37.58	42.26	-53.43	42.26	-251.80
10Y	24.41	7.35	17.06	25.47	18.91	36.30	-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	34.50	-1.00	35.50	34.00	35.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	59.10	-2.10	61.20	58.50	61.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	44.62	1.12	43.50	44.34	42.83	128.30	41.06	243.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6Y 25.5						
06M									
09M									
01Y	85								
1.5Y									
02Y	2.5 / 02 / 1.75	SPRD	2*5Y 22.5						
03Y	12.25 / 11 / 10.75								
04Y	19								
05Y	25.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1Y CCS 7.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	48 건	-40	88	50	41	41	72	139	
금 액	10,900 억원	-12,210	23,110	12,690	10,320	10,320	20,675	48,890	

장중동향
국고채 금리, 하락 마감.
국채선물은 오전 장 한때 유연식 한국은행 부총재가 가계부채가 상당 기간 한국 경제에 부담 요인으로 작용할 수 있다고 밝히면서 상승 폭을 일부 반납했으나 아시아시장에서 미국 국채금리가 하락 전환하면서 장중 강세 폭이 확대.

IRS, 금리 전 구간에서 하락. 볼 플래트닝.
전일 미국 금리하락 영향에 IRS도 오퍼 우위의 장세가 이어짐. 장 후반 유럽 금융시장에서 독일 10년 국채금리가 4bp가량 내리자 IRS와 국채선물의 강세 분위기가 더욱 짙어짐.