

IPS Daily Morning Brief

2018-06-15

종가 기준일 2018-06-14

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7450	2.75	1.7225	1.7168	1.7233	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.8300	3.75	1.7980	1.7888	1.7893	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8850	3.75	1.8540	1.8476	1.8493	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9775	3.75	1.9460	1.9438	1.9485	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	2.0450	3.25	2.0190	2.0233	2.0240	2.1150	1.4825	2.8275	1.1675
3Y	2.1400	2.75	2.1195	2.1240	2.1231	2.2225	1.5200	2.9250	1.1550
4Y	2.2050	2.25	2.1890	2.1929	2.1890	2.2950	1.5775	3.0150	1.1575
5Y	2.2475	1.50	2.2370	2.2409	2.2342	2.3400	1.6350	3.0950	1.1575
7Y	2.2950	1.00	2.2890	2.2961	2.2845	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.3650	0.75	2.3610	2.3683	2.3530	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.4050	0.75	2.4010	2.4083	2.3958	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.4325	0.75	2.4285	2.4346	2.4180	2.5400	1.8150	3.4125	1.2150
20Y	2.4625	0.75	2.4585	2.4659	2.4434	2.5600	1.7450	3.5325	1.2150

6*9M	8.50	1.00	7.55	7.20	6.60	12.50	-0.75	12.50	-6.00
9*12M	5.50	0.00	5.60	5.89	6.01	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	16.00	-0.50	16.50	17.56	17.46	23.00	1.00	23.00	-5.50
2*3Y	9.50	-0.50	10.05	10.08	9.91	13.25	3.75	13.25	-1.75
2*4Y	16.00	-1.00	17.00	16.96	16.50	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	20.25	-1.75	21.80	21.76	21.02	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	6.50	-0.50	6.95	6.89	6.59	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	10.75	-1.25	11.75	11.69	11.11	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	4.25	-0.75	4.80	4.80	4.52	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.75	-0.50	5.20	5.53	5.03	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.75	-0.75	12.40	12.74	11.89	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	-0.25	7.20	7.21	6.85	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.28	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.64	6.50	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.00	9.75	9.76	9.04	10.00	-6.25	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.890	3.50	1.858	1.851	1.861	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.049	2.80	2.025	2.006	2.021	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.137	2.50	2.119	2.122	2.132	2.230	1.567	2.818	1.225
3Y	2.225	1.00	2.211	2.209	2.218	2.315	1.617	2.913	1.200
4Y	2.392	1.40	2.382	2.390	2.396	2.502	1.730	3.125	1.232
5Y	2.500	1.00	2.490	2.496	2.481	2.602	1.792	3.208	1.217
7Y	2.630	0.20	2.625	2.623	2.606	2.728	1.993	3.370	1.270
10Y	2.710	-0.50	2.715	2.724	2.702	2.815	2.085	3.585	1.355
20Y	2.699	-0.50	2.703	2.721	2.705	2.792	2.122	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	107.89	-0.05	107.81	107.92	107.81
LKTb	119.92	0.02	119.66	120.03	119.66

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	0.25	-0.44	-0.37	-1.21	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.15	0.95	-7.86	-6.26	-7.22	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-9.20	0.75	-9.96	-9.90	-10.78	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-8.50	1.75	-9.19	-8.55	-9.47	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-18.70	0.85	-19.30	-19.71	-20.72	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-25.25	0.50	-25.30	-25.54	-24.64	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.50	0.80	-33.62	-32.67	-32.13	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-34.50	1.25	-35.42	-35.56	-34.88	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-23.65	1.25	-24.41	-25.55	-26.14	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1083.10 (+5.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-71.50	2.25	1Y	1.1700	6.00	1.6200	0.7650	1*2Y	8.50	0.00		
-77.75	2.25	1.5Y	1.2000	6.00	1.6600	0.8100	2*3Y	4.00	0.00		
-79.00	2.75	2Y	1.2550	6.00	1.6950	0.8650	2*5Y	8.00	-0.50		
-84.50	3.25	3Y	1.2950	6.00	1.7550	0.9550	3*4Y	1.50	-0.50		
-89.50	3.25	4Y	1.3100	5.50	1.8000	1.0150	3*5Y	4.00	-0.50		
-91.25	4.00	5Y	1.3350	5.50	1.8500	1.0350	4*5Y	2.50	0.00		
-88.00	4.00	7Y	1.4150	5.00	1.8950	1.0400	5*7Y	8.00	-0.50		
-72.00	3.25	10Y	1.6450	4.00	2.0500	1.0500	5*10Y	31.00	-1.50		

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	2.5655	0.0001	2.5654	2.5449	2.5161	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.9382	-0.0285	2.9667	2.9630	2.9538	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	42.85	-2.49	45.34	43.29	39.91	45.34	-53.43	45.34	-251.80
10Y	22.82	-2.35	25.17	24.80	22.38	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	32.00	-2.50	34.50	34.50	35.50	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	57.30	-3.00	60.30	60.30	61.30	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	37.27	-2.86	40.13	41.81	43.77	128.30	37.27	243.00	37.27

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor	21M 0.62			
06M	73 / 74.5 / 73.75								
09M	82 / 82.25								
01Y	87.75 / 88 / 88.25 / 87								
1.5Y	96.5								
02Y	4.5					2*7Y 25.5			
03Y	13.25				SPRD	3*5Y 10.75			
04Y	21								
05Y	25.5 / 24.25 / 24.75								
07Y	29.5								
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1Y CCS 17								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	115 건		52	63	63	36	48	88	50
금 액	50,143 억원		29,313	20,830	20,830	8,900	10,900	23,110	12,690

장중동향
국고채 금리, 보험세.
국채 선물은 미국의 금리 인상을 반영해 하락 출발지만 시장 예상 수준이라 크게 영향을 미치지 못하며 3년물은 장중 낙폭을 계속 만회했고 10년물은 반등했다가 강보합세로 마감.

IRS 금리, 상승. 커브 플랫트닝.
매파적인 금통위 의사록에 FOMC 결과도 매파적으로 나오면서 단기구간을 중심으로 비드가 나오면서 상승. 10년 국채선물이 장중 강세를 보이면서 오퍼가 나오기 했지만, 유럽장이 열리면서 다시 비드가 우위를 보임.