IPS Daily Morning Brief

2018-06-19

종가 기준일 2018-06-18

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7250	-1.00	1.7280	1.7179	1.7240	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.8100	-1.00	1.8090	1.7918	1.7908	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8600	-1.00	1.8620	1.8491	1.8506	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9475	-0.75	1.9520	1.9431	1.9494	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	2.0100	-1.00	2.0200	2.0200	2.0241	2.1150	1.4950	2.8275	1.1675
3Y	2.0950	-1.50	2.1140	2.1188	2.1225	2.2225	1.5325	2.9250	1.1550
4Y	2.1575	-1.75	2.1805	2.1873	2.1882	2.2950	1.5900	3.0150	1.1575
5Y	2.1950	-2.00	2.2245	2.2346	2.2332	2.3400	1.6450	3.0950	1.1575
7Y	2.2350	-2.50	2.2720	2.2883	2.2833	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.3050	-2.50	2.3430	2.3598	2.3521	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.3450	-2.50	2.3830	2.3998	2.3947	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.3725	-2.50	2.4105	2.4265	2.4172	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.4025	-2.50	2.4405	2.4573	2.4429	2.5600	1.7625	3.5325	1.2150

6*9M	8.50	0.00	8.10	7.39	6.68	12.50	-0.75	12.50	-6.00
9*12M	5.00	0.00	5.30	5.74	5.98	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	15.00	0.00	15.80	17.09	17.35	23.00	2.00	23.00	-5.50
2*3Y	8.50	-0.50	9.40	9.88	9.83	13.25	3.75	13.25	-1.75
2*4Y	14.75	-0.75	16.05	16.73	16.40	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	18.50	-1.00	20.45	21.46	20.91	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	6.25	-0.25	6.65	6.85	6.57	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	10.00	-0.50	11.05	11.59	11.08	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.75	-0.25	4.40	4.74	4.50	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	-0.50	4.75	5.36	5.01	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.00	-0.50	11.85	12.51	11.89	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.00	7.10	7.15	6.88	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.26	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.67	6.51	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.00	9.75	9.75	9.08	10.00	-6.25	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.885	-0.20	1.874	1.856	1.861	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.034	-0.50	2.033	2.008	2.021	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.112	-0.80	2.119	2.120	2.131	2.230	1.577	2.818	1.225
3Y	2.177	-1.50	2.205	2.204	2.216	2.315	1.617	2.913	1.200
4Y	2.352	-1.30	2.373	2.385	2.394	2.502	1.737	3.125	1.232
5Y	2.451	-2.10	2.481	2.491	2.481	2.602	1.805	3.208	1.217
7Y	2.576	-2.40	2.612	2.617	2.606	2.728	1.993	3.370	1.270
10Y	2.651	-2.60	2.694	2.714	2.702	2.815	2.102	3.585	1.355
20Y	2.640	-3.00	2.683	2.710	2.704	2.792	2.154	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	108.04	0.05	108.01	108.07	107.98
LKTB	120.48	0.27	120.29	120.62	120.19

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-2.50	-0.80	-1.24	-0.66	-1.04	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-8.65	-0.25	-8.08	-6.47	-7.17	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.20	-0.20	-9.86	-9.99	-10.69	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-8.20	0.00	-9.08	-8.57	-9.37	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-19.45	-0.45	-19.25	-19.74	-20.58	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-25.60	0.10	-25.61	-25.63	-24.77	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-34.10	-0.10	-34.04	-32.88	-32.27	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-34.60	0.10	-35.06	-35.47	-34.95	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-23.75	0.50	-24.29	-25.31	-26.14	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-65.00	0.00
-70.75	0.25
-71.50	0.50
-75.50	1.50
-80.25	1.75
-81.50	2.00
-80.00	2.50
-66.50	2.50

CRS

USD/KRW 1104.80 (+7.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2100	-1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	8.50	0.50
1.5Y	1.2400	-0.50	1.6600	0.8100	2*3Y	4.50	0.50
2Y	1.2950	-0.50	1.6950	0.8650	2*5Y	8.50	0.50
3Y	1.3400	0.00	1.7550	0.9550	3*4Y	1.50	0.00
4Y	1.3550	0.00	1.8000	1.0150	3*5Y	4.00	0.00
5Y	1.3800	0.00	1.8500	1.0350	4*5Y	2.50	0.00
7Y	1.4350	0.00	1.8950	1.0400	5*7Y	5.50	0.00
10Y	1.6400	0.00	2.0500	1.0500	5*10Y	26.00	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	2.5699	0.0166	2.5533	2.5655	2.5654	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.9154	-0.0091	2.9245	2.9382	2.9667	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	45.79	2.46	43.33	42.85	45.34	45.79	-53.43	45.79	-251.80
10Y	26.44	1.69	24.75	22.82	25.17	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	29.50	-1.50	31.00	32.00	34.50	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	53.90	-1.80	55.70	57.30	60.30	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	34.55	-2.57	37.12	37.27	40.13	128.30	34.55	243.00	34.55

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	01 / 0.5		
1.5Y	94.25 / 94.5 / 94.75		
02Y		SPRD	3*5Y 10
03Y	10 / 9.5		5*10Y 11
04Y	15.5		
05Y	19		
07Y			
10Y	30.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1.5y CCS 24 2y CCS 29.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	73 건	-55	128	115	63	63	36	48
금 액	14,935 억원	-25,393	40,328	50,143	20,830	20,830	8,900	10,900

장중동향

국고채 금리, 미·중 무역분쟁 우려로 아시아시장에서 미 금리가 하락한 영향이 이어지며 금리 하락.
단기 구간은 반기말 영향 등으로 약한데 비해, 국채선물은 롤오버 이슈 등으로 강세를 보임.

IRS, 전 구간 금리 하락. 커브 플래트닝
거래가 많지 않은 가운데 오퍼가 우위를 보이며 1.5-3Y 구간 위주로 거래.

CRS, 1.5-3Y 구간 금리 하락 & 이 외 구간 보합 마감.