

IPS Daily Morning Brief

2018-06-20

종가 기준일 2018-06-19

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7200	-0.50	1.7285	1.7176	1.7240	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.8050	-0.50	1.8115	1.7924	1.7913	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8525	-0.75	1.8630	1.8489	1.8509	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9350	-1.25	1.9510	1.9414	1.9493	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9975	-1.25	2.0170	2.0169	2.0238	2.1150	1.4975	2.8275	1.1675
3Y	2.0725	-2.25	2.1060	2.1140	2.1215	2.2225	1.5425	2.9250	1.1550
4Y	2.1300	-2.75	2.1700	2.1820	2.1870	2.2950	1.5975	3.0150	1.1575
5Y	2.1675	-2.75	2.2115	2.2290	2.2320	2.3400	1.6450	3.0950	1.1575
7Y	2.2075	-2.75	2.2565	2.2818	2.2819	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2725	-3.25	2.3260	2.3528	2.3507	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.3125	-3.25	2.3660	2.3928	2.3933	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.3400	-3.25	2.3935	2.4196	2.4158	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3700	-3.25	2.4235	2.4501	2.4417	2.5600	1.7800	3.5325	1.2150

6*9M	8.50	0.00	8.30	7.48	6.73	12.50	-0.75	12.50	-6.00
9*12M	4.75	-0.25	5.15	5.65	5.96	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	14.50	-0.50	15.40	16.80	17.28	23.00	2.50	23.00	-5.50
2*3Y	7.50	-1.00	8.90	9.71	9.77	13.25	4.25	13.25	-1.75
2*4Y	13.25	-1.50	15.30	16.51	16.33	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	17.00	-1.50	19.45	21.21	20.83	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.75	-0.50	6.40	6.80	6.55	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	9.50	-0.50	10.55	11.50	11.05	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.75	0.00	4.15	4.70	4.50	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.00	4.50	5.28	4.99	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.50	-0.50	11.45	12.38	11.87	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	-0.50	6.95	7.10	6.88	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.25	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.69	6.51	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.00	9.75	9.74	9.10	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	0.00	1.880	1.858	1.861	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.029	-0.50	2.034	2.008	2.021	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.096	-1.60	2.115	2.117	2.130	2.230	1.577	2.818	1.225
3Y	2.155	-2.20	2.193	2.200	2.215	2.315	1.617	2.913	1.200
4Y	2.312	-4.00	2.360	2.379	2.392	2.502	1.737	3.125	1.232
5Y	2.407	-4.40	2.464	2.485	2.480	2.602	1.805	3.208	1.217
7Y	2.536	-4.00	2.594	2.611	2.605	2.728	1.993	3.370	1.270
10Y	2.612	-3.90	2.673	2.707	2.701	2.815	2.102	3.585	1.355
20Y	2.605	-3.50	2.664	2.702	2.703	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	107.86	-0.18	107.83	107.90	107.77
LKTb	120.52	0.04	120.32	120.60	120.21

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	-3.25	-0.75	-1.74	-0.87	-0.99	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-9.40	-0.75	-8.34	-6.62	-7.17	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-9.85	0.35	-9.84	-10.00	-10.65	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-8.25	-0.05	-8.68	-8.58	-9.35	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-18.20	1.25	-18.98	-19.71	-20.51	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-23.95	1.65	-25.25	-25.60	-24.81	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.85	1.25	-33.75	-32.93	-32.33	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-33.95	0.65	-34.70	-35.41	-34.99	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-23.50	0.25	-24.01	-25.20	-26.16	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1109.10 (+4.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-68.75	-3.75	1Y	1.1650	-4.50	1.6200	0.7650	1*2Y	11.00	2.50	
-71.50	-0.75	1.5Y	1.2200	-2.00	1.6600	0.8100	2*3Y	5.00	0.50	
-72.25	-0.75	2Y	1.2750	-2.00	1.6950	0.8650	2*5Y	11.00	2.50	
-74.75	0.75	3Y	1.3250	-1.50	1.7550	0.9550	3*4Y	3.00	1.50	
-77.50	2.75	4Y	1.3550	0.00	1.8000	1.0150	3*5Y	6.00	2.00	
-78.25	3.25	5Y	1.3850	0.50	1.8500	1.0350	4*5Y	3.00	0.50	
-78.25	1.75	7Y	1.4250	-1.00	1.8950	1.0400	5*7Y	4.00	-1.50	
-64.25	2.25	10Y	1.6300	-1.00	2.0500	1.0500	5*10Y	24.50	-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	2.5493	-0.0206	2.5699	2.5533	2.5655	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.8971	-0.0183	2.9154	2.9245	2.9382	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	45.33	-0.46	45.79	43.33	42.85	45.79	-53.43	45.79	-251.80
10Y	28.51	2.07	26.44	24.75	22.82	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	27.50	-2.00	29.50	31.00	32.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	51.60	-2.30	53.90	55.70	57.30	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	34.78	0.23	34.55	37.12	37.27	128.30	34.55	243.00	34.55

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	81 / 80.75 / 80.5								
01Y	85.25								
1.5Y	94.25								
02Y	0.75 / 99.75	SPRD	2*3Y	8.5					
03Y	9		1*3Y	22.75					
04Y			4*7Y	7.5					
05Y	17.5 / 16.5 / 17 / 16.75		5*10Y	10.5					
07Y			1*2Y	14.5					
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	105 건	32	73	128	115	63	63	36	
금 액	29,350 억원	14,415	14,935	40,328	50,143	20,830	20,830	8,900	

장중동향

국고채 금리, 하락.

국채선물은 美中 무역전쟁 우려를 반영해 상승 출발. 이주열 한국은행 총재의 오찬 기자간담회를 앞두고 일부 경계 물량이 나오기도 했지만 오후에 공개된 기자간담회 내용은 시장에 큰 영향을 미치지 않음.

IRS, 전 구간 금리 하락. 커브 플레이트닝.

현물 및선물과 달리 역외 비드로 인한 비디쉬한 모습.

CRS, 1-3Y과 7-10Y 금리 하락 & 5Y 0.5bp 상승 & 4Y 보합 마감.