

IPS Daily Morning Brief

2018-06-21

종가 기준일 2018-06-20

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7250	0.50	1.7300	1.7175	1.7243	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.8075	0.25	1.8145	1.7930	1.7919	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8575	0.50	1.8650	1.8489	1.8514	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9375	0.25	1.9505	1.9401	1.9494	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	2.0000	0.25	2.0145	2.0146	2.0236	2.1150	1.4975	2.8275	1.1675
3Y	2.0750	0.25	2.0985	2.1104	2.1208	2.2225	1.5425	2.9250	1.1550
4Y	2.1325	0.25	2.1600	2.1779	2.1863	2.2950	1.5975	3.0150	1.1575
5Y	2.1700	0.25	2.1990	2.2245	2.2313	2.3400	1.6450	3.0950	1.1575
7Y	2.2100	0.25	2.2415	2.2764	2.2810	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2750	0.25	2.3095	2.3469	2.3499	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.3150	0.25	2.3495	2.3869	2.3924	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.3425	0.25	2.3770	2.4139	2.4151	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3775	0.75	2.4080	2.4444	2.4412	2.5600	1.7800	3.5325	1.2150

6*9M	8.25	-0.25	8.45	7.55	6.76	12.50	-0.75	12.50	-6.00
9*12M	5.00	0.25	5.05	5.59	5.95	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	14.25	-0.25	14.95	16.58	17.22	23.00	2.50	23.00	-5.50
2*3Y	7.50	0.00	8.40	9.58	9.73	13.25	4.50	13.25	-1.75
2*4Y	13.25	0.00	14.55	16.33	16.27	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	17.00	0.00	18.45	20.99	20.77	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.75	0.00	6.15	6.75	6.55	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	9.50	0.00	10.05	11.41	11.04	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.75	0.00	3.90	4.66	4.50	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.00	4.25	5.19	4.98	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.50	0.00	11.05	12.24	11.87	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.80	7.05	6.89	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	6.70	6.52	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	10.25	0.50	9.85	9.75	9.13	10.25	-6.25	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.892	0.70	1.888	1.859	1.861	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.036	0.70	2.037	2.008	2.021	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.100	0.40	2.113	2.115	2.130	2.230	1.577	2.818	1.225
3Y	2.160	0.50	2.182	2.197	2.214	2.315	1.617	2.913	1.200
4Y	2.310	-0.20	2.346	2.374	2.391	2.502	1.737	3.125	1.232
5Y	2.407	0.00	2.447	2.480	2.480	2.602	1.805	3.208	1.217
7Y	2.536	0.00	2.576	2.606	2.605	2.728	1.993	3.370	1.270
10Y	2.612	0.00	2.652	2.700	2.700	2.815	2.102	3.585	1.355
20Y	2.607	0.20	2.644	2.695	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	107.87	0.01	107.84	107.88	107.81
LKTb	120.57	0.05	120.40	120.65	120.34

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	-3.45	-0.20	-2.28	-1.03	-0.93	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-9.85	-0.45	-8.69	-6.81	-7.18	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.00	-0.15	-9.85	-10.04	-10.60	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-8.50	-0.25	-8.33	-8.61	-9.31	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-17.75	0.45	-18.62	-19.66	-20.42	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-23.70	0.25	-24.84	-25.56	-24.83	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.60	0.25	-33.41	-32.99	-32.38	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-33.70	0.25	-34.29	-35.35	-35.02	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-22.95	0.55	-23.62	-25.06	-26.17	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1105.10 (-4.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-79.75	-11.00	1Y	1.0600	-10.50	1.6200	0.7650	1*2Y	13.00	2.00		
-81.25	-9.75	1.5Y	1.1250	-9.50	1.6600	0.8100	2*3Y	7.00	2.00		
-81.00	-8.75	2Y	1.1900	-8.50	1.6950	0.8650	2*5Y	14.50	3.50		
-81.50	-6.75	3Y	1.2600	-6.50	1.7550	0.9550	3*4Y	4.50	1.50		
-82.75	-5.25	4Y	1.3050	-5.00	1.8000	1.0150	3*5Y	7.50	1.50		
-83.50	-5.25	5Y	1.3350	-5.00	1.8500	1.0350	4*5Y	3.00	0.00		
-83.50	-5.25	7Y	1.3750	-5.00	1.8950	1.0400	5*7Y	4.00	0.00		
-70.50	-6.25	10Y	1.5700	-6.00	2.0500	1.0500	5*10Y	23.50	-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	2.5659	0.0166	2.5493	2.5699	2.5533	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.5493	-0.3478	2.8971	2.9154	2.9245	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	46.59	1.26	45.33	45.79	43.33	46.59	-53.43	46.59	-251.80
10Y	-6.27	-34.78	28.51	26.44	24.75	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	0.00	27.50	29.50	31.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	51.20	-0.40	51.60	53.90	55.70	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	-1.66	-36.44	34.78	34.55	37.12	128.30	-1.66	243.00	-1.66

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
	06M								
	09M		80.75 / 81.25						
	01Y		85.25 / 85.5 / 86						
	1.5Y		93.75						
	02Y		99.75 / 00 / 0.25 /						
	03Y	7.75	SPRD	9*12m	4.75				
	04Y			4*5y	3.75				
	05Y	16.75 / 17 / 17.25		4*7y	7.5				
	07Y			5*10y	10.75				
	10Y	27 / 27.75		10*20y	10.25				
	12Y								
	15Y								
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	124 건	19	105	73	128	115	63	63	
금 액	52,620 억원	23,270	29,350	14,935	40,328	50,143	20,830	20,830	

장중동향
 채권 단기약세, 상대적으로 중장기강세. 커브 플랫닝.
 장 시작후 미국금리 상승으로 약세 출발한 채권은, 외국인인 매수세에 오히려 강보합 전환.
 IRS는 오전에 단기 중기쪽으로 오퍼리시. 아시아장에서 미국금리가 상승하면서 비드가 우위를 보이며 전구간 소폭 상승 마감.
 CRS는 FX스왑이 급락한 영향으로 단기를 중심으로 레벨이 크게 하락하며 커브 스프릿 마감.