IPS Daily Morning Brief

2018-06-22

종가 기준일 2018-06-21

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7225	-0.25	1.7255	1.7185	1.7244	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.8000	-0.75	1.8085	1.7943	1.7923	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8500	-0.75	1.8580	1.8495	1.8517	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9300	-0.75	1.9410	1.9396	1.9493	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9875	-1.25	2.0030	2.0131	2.0233	2.1150	1.4975	2.8275	1.1675
3Y	2.0600	-1.50	2.0825	2.1075	2.1200	2.2225	1.5425	2.9250	1.1550
4Y	2.1125	-2.00	2.1415	2.1743	2.1853	2.2950	1.5975	3.0150	1.1575
5Y	2.1500	-2.00	2.1795	2.2205	2.2302	2.3400	1.6450	3.0950	1.1575
7Y	2.1925	-1.75	2.2210	2.2714	2.2799	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2575	-1.75	2.2880	2.3413	2.3489	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2975	-1.75	2.3280	2.3813	2.3913	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.3250	-1.75	2.3555	2.4084	2.4141	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3600	-1.75	2.3875	2.4389	2.4404	2.5600	1.7800	3.5325	1.2150

6*9M	7.75	-0.50	8.30	7.58	6.79	12.50	-0.75	12.50	-6.00
9*12M	5.00	0.00	4.95	5.53	5.94	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	13.75	-0.50	14.50	16.36	17.15	23.00	2.50	23.00	-5.50
2*3Y	7.25	-0.25	7.95	9.44	9.68	13.25	4.50	13.25	-1.75
2*4Y	12.50	-0.75	13.85	16.11	16.20	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	16.25	-0.75	17.65	20.74	20.70	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.25	-0.50	5.90	6.68	6.53	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	9.00	-0.50	9.70	11.30	11.02	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.75	0.00	3.80	4.63	4.49	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.25	0.25	4.15	5.09	4.97	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.75	0.25	10.85	12.08	11.87	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.70	6.99	6.90	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.24	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.71	6.52	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	10.25	0.00	9.95	9.76	9.15	10.25	-6.25	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.881	-1.10	1.886	1.861	1.860	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.018	-1.80	2.031	2.009	2.021	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.091	-0.90	2.104	2.114	2.129	2.230	1.577	2.818	1.225
3Y	2.144	-1.60	2.166	2.194	2.213	2.315	1.617	2.913	1.200
4Y	2.290	-2.00	2.326	2.370	2.389	2.502	1.737	3.125	1.232
5Y	2.390	-1.70	2.425	2.476	2.479	2.602	1.805	3.208	1.217
7Y	2.518	-1.80	2.553	2.602	2.604	2.728	1.993	3.370	1.270
10Y	2.595	-1.70	2.629	2.694	2.699	2.815	2.102	3.585	1.355
20Y	2.600	-0.70	2.624	2.688	2.702	2.792	2.154	3.799	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.48	3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.93	0.06	107.83	107.94	107.82
LKTB	120.78	0.21	120.40	120.81	120.36

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	-3.10	0.35	-2.80	-1.16	-0.86	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-8.80	1.05	-9.02	-6.97	-7.16	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.35	-0.35	-10.08	-10.11	-10.56	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-8.40	0.10	-8.31	-8.67	-9.27	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-17.75	0.00	-18.43	-19.60	-20.33	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-24.00	-0.30	-24.59	-25.51	-24.86	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.55	0.05	-33.22	-33.03	-32.43	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-33.75	-0.05	-34.14	-35.29	-35.06	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.00	-1.05	-23.69	-24.95	-26.19	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-77.00	2.75
-78.50	2.75
-78.25	2.75
-78.50	3.00
-78.75	4.00
-79.00	4.50
-79.25	4.25
-66.25	4.25

CRS

USD/KRW 1112.80 (+7.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.0800	2.00	1.6200	0.7650	1*2Y	12.50	-0.50
1.5Y	1.1450	2.00	1.6600	0.8100	2*3Y	7.00	0.00
2Y	1.2050	1.50	1.6950	0.8650	2*5Y	15.50	1.00
3Y	1.2750	1.50	1.7550	0.9550	3*4Y	5.00	0.50
4Y	1.3250	2.00	1.8000	1.0150	3*5Y	8.50	1.00
5Y	1.3600	2.50	1.8500	1.0350	4*5Y	3.50	0.50
7Y	1.4000	2.50	1.8950	1.0400	5*7Y	4.00	0.00
10Y	1.5950	2.50	2.0500	1.0500	5*10Y	23.50	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	2.5369	-0.0290	2.5659	2.5493	2.5699	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.8980	-0.0394	2.9374	2.8971	2.9154	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	44.59	-2	46.59	45.33	45.79	46.59	-53.43	46.59	-251.80
10Y	30.30	-2.24	32.54	28.51	26.44	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	27.00	-0.50	27.50	27.50	29.50	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	50.40	-0.80	51.20	51.60	53.90	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	36.11	-1.04	37.15	34.78	34.55	128.30	34.55	243.00	34.55

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	72.5	ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	93.75 / 93.5 / 93.25		
02Y	99.5 / 98.5	SPRD	6*12M 12.75
03Y			2*4Y 13.25
04Y	14		2*5Y 17
05Y	17.75 / 17.25		4*5Y 3.75
07Y			5*10Y 10.5 / 10.75
10Y	27.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1.5y CCS 14		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	80 건	-44	124	105	73	128	115	63
금 액	24,520 억원	-28,100	52,620	29,350	14,935	40,328	50,143	20,830

장중동향

국고채 금리, 장중 국고 50년물 입찰 & 외인 선물 매수세 영향을 받아 금리 하락 마감.
(5천400억 원/가중평균금리 2.510%/응찰률 208.0%)

IRS, 전 구간에서 금리 하락. 커브 플래트닝.
50년물 입찰 호조로 장기물 금리가 더 많이 하락.
CRS, 금리 상승 마감.
이틀동안 FX스왑포인트와 금리가 급락하면서 에셋 물량이 쏟아졌지만, 오버 슈팅 인식과 단시 스왑포인트 반등으로 진정세. 부채 스왑이 예정돼 있어 중기 위주의 비드도 일부 출현.