

IPS Daily Morning Brief

2018-06-25

종가 기준일 2018-06-22

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7250	0.25	1.7235	1.7193	1.7246	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7975	-0.25	1.8040	1.7950	1.7928	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8475	-0.25	1.8535	1.8496	1.8520	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9300	0.00	1.9360	1.9389	1.9493	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9925	0.50	1.9975	2.0115	2.0231	2.1150	1.4975	2.8275	1.1675
3Y	2.0675	0.75	2.0740	2.1044	2.1195	2.2225	1.5425	2.9250	1.1550
4Y	2.1225	1.00	2.1310	2.1705	2.1847	2.2950	1.5975	3.0150	1.1575
5Y	2.1625	1.25	2.1690	2.2166	2.2296	2.3400	1.6450	3.0950	1.1575
7Y	2.2075	1.50	2.2105	2.2669	2.2792	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2750	1.75	2.2770	2.3363	2.3485	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.3150	1.75	2.3170	2.3763	2.3908	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.3425	1.75	2.3445	2.4035	2.4137	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3775	1.75	2.3775	2.4343	2.4402	2.5600	1.7800	3.5325	1.2150

6*9M	7.25	-0.50	8.05	7.58	6.81	12.50	-0.75	12.50	-6.00
9*12M	5.00	0.00	4.95	5.46	5.93	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	14.50	0.75	14.40	16.19	17.11	23.00	2.50	23.00	-5.50
2*3Y	7.50	0.25	7.65	9.29	9.64	13.25	4.50	13.25	-1.75
2*4Y	13.00	0.50	13.35	15.90	16.16	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	17.00	0.75	17.15	20.51	20.65	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.50	0.25	5.70	6.61	6.52	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	9.50	0.50	9.50	11.23	11.01	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.25	3.80	4.61	4.49	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.50	0.25	4.15	5.03	4.96	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.25	0.50	10.80	11.96	11.89	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	0.25	6.65	6.94	6.93	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.23	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.72	6.53	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	10.25	0.00	10.05	9.80	9.18	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	0.00	1.885	1.863	1.860	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.002	-1.60	2.024	2.010	2.020	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.094	0.30	2.099	2.113	2.128	2.230	1.577	2.818	1.225
3Y	2.147	0.30	2.157	2.191	2.212	2.315	1.617	2.913	1.200
4Y	2.297	0.70	2.312	2.366	2.387	2.502	1.737	3.125	1.232
5Y	2.402	1.20	2.411	2.471	2.478	2.602	1.805	3.208	1.217
7Y	2.533	1.50	2.540	2.598	2.604	2.728	1.993	3.370	1.270
10Y	2.612	1.70	2.616	2.689	2.699	2.815	2.102	3.585	1.355
20Y	2.605	0.50	2.611	2.683	2.702	2.792	2.154	3.799	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.45	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.92	-0.01	107.92	107.97	107.90
LKTb	120.62	-0.16	120.78	120.86	120.62

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	-3.35	-0.25	-3.13	-1.30	-0.81	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.20	1.60	-8.78	-7.07	-7.12	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.15	0.20	-10.11	-10.17	-10.51	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-7.95	0.45	-8.26	-8.71	-9.21	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-17.45	0.30	-18.12	-19.53	-20.24	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-23.95	0.05	-24.24	-25.48	-24.89	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.55	0.00	-32.93	-33.08	-32.48	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-33.70	0.05	-33.94	-35.25	-35.08	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-22.75	1.25	-23.39	-24.83	-26.16	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1107.40 (-5.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-72.25	4.75	1Y	1.1250	4.50	1.6200	0.7650	1*2Y	10.50	-2.00		
-75.00	3.50	1.5Y	1.1800	3.50	1.6600	0.8100	2*3Y	7.00	0.00		
-76.25	2.00	2Y	1.2300	2.50	1.6950	0.8650	2*5Y	15.00	-0.50		
-76.75	1.75	3Y	1.3000	2.50	1.7550	0.9550	3*4Y	4.50	-0.50		
-77.75	1.00	4Y	1.3450	2.00	1.8000	1.0150	3*5Y	8.00	-0.50		
-78.25	0.75	5Y	1.3800	2.00	1.8500	1.0350	4*5Y	3.50	0.00		
-78.75	0.50	7Y	1.4200	2.00	1.8950	1.0400	5*7Y	4.00	0.00		
-66.00	0.25	10Y	1.6150	2.00	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	2.5412	0.0043	2.5369	2.5659	2.5493	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.8961	-0.0019	2.8980	2.9374	2.8971	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	44.72	0.13	44.59	46.59	45.33	46.59	-53.43	46.59	-251.80
10Y	28.41	-1.89	30.30	32.54	28.51	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	28.25	1.25	27.00	27.50	27.50	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	51.80	1.40	50.40	51.20	51.60	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	35.49	-0.62	36.11	37.15	34.78	128.30	34.55	243.00	34.55

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6y 17.25						
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	93								
02Y	98.75 / 99 / 99.25	SPRD	1.5*2y 06						
03Y	06 / 6.25		1.5*3y 13.25						
04Y	11.25		2*3y 7.75						
05Y	14.75 / 15.25		4*6y 06						
07Y	19 / 19.5								
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	124 건	44	80	124	105	73	128	115	
금 액	45,310 억원	20,790	24,520	52,620	29,350	14,935	40,328	50,143	

장중동향
채권금리 약보합 장기금리 상승.
이번주 50년물 입찰 호조와 미중 무역전쟁등으로 강세였던 채권은 약간의 되돌림과 10년선물에서 매도로 돌아선 외국인의 영향으로 강기폭이 상승하며 커브 스텝마감.

IRS 국채선물과 연동되어 움직이며 베어스티프닝. 1년을 제외한 전구간 상승했고 장기테너가 1.75bp까지 상승.

CRS는 전테너 상승마감.