IPS Daily Morning Brief

2018-06-26

종가 기준일 2018-06-25

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7225	-0.25	1.7230	1.7201	1.7247	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7925	-0.50	1.8005	1.7958	1.7930	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8425	-0.50	1.8500	1.8498	1.8521	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9200	-1.00	1.9305	1.9379	1.9490	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9825	-1.00	1.9920	2.0095	2.0227	2.1150	1.4975	2.8275	1.1675
3Y	2.0550	-1.25	2.0660	2.1010	2.1186	2.2225	1.5425	2.9250	1.1550
4Y	2.1100	-1.25	2.1215	2.1664	2.1837	2.2950	1.5975	3.0150	1.1575
5Y	2.1500	-1.25	2.1600	2.2121	2.2286	2.3400	1.6450	3.0950	1.1575
7Y	2.1950	-1.25	2.2025	2.2618	2.2782	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2625	-1.25	2.2685	2.3309	2.3476	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.3025	-1.25	2.3085	2.3709	2.3898	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.3300	-1.25	2.3360	2.3983	2.4129	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3650	-1.25	2.3700	2.4293	2.4396	2.5600	1.7800	3.5325	1.2150

6*9M	7.00	-0.25	7.75	7.56	6.83	12.50	-0.75	12.50	-6.00
9*12M	5.00	0.00	4.95	5.40	5.91	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	14.00	-0.50	14.20	15.98	17.05	23.00	2.50	23.00	-5.50
2*3Y	7.25	-0.25	7.40	9.15	9.59	13.25	4.50	13.25	-1.75
2*4Y	12.75	-0.25	12.95	15.69	16.10	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	16.75	-0.25	16.80	20.26	20.59	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.50	0.00	5.55	6.54	6.51	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	9.50	0.00	9.40	11.11	11.00	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.00	3.85	4.58	4.49	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.50	0.00	4.25	4.96	4.96	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	11.25	0.00	10.85	11.88	11.90	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	0.00	6.60	6.91	6.94	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.22	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.74	6.53	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	10.25	0.00	10.15	9.84	9.20	10.25	-6.25	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.882	0.10	1.884	1.863	1.860	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.996	-0.60	2.016	2.009	2.020	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.088	-0.60	2.094	2.112	2.127	2.230	1.577	2.818	1.225
3Y	2.137	-1.00	2.149	2.188	2.210	2.315	1.617	2.913	1.200
4Y	2.280	-1.70	2.298	2.361	2.385	2.502	1.737	3.125	1.232
5Y	2.390	-1.20	2.399	2.466	2.478	2.602	1.805	3.208	1.217
7Y	2.520	-1.30	2.529	2.593	2.603	2.728	1.993	3.370	1.270
10Y	2.600	-1.20	2.606	2.683	2.699	2.815	2.102	3.585	1.355
20Y	2.597	-0.80	2.603	2.676	2.701	2.792	2.154	3.799	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.51	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.97	0.05	107.97	107.97	107.93
LKTB	120.78	0.16	120.82	120.84	120.64

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	-3.95	-0.60	-3.42	-1.37	-0.77	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.60	-0.40	-8.57	-7.15	-7.09	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.55	-0.40	-10.18	-10.23	-10.48	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-8.20	-0.25	-8.26	-8.72	-9.16	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-17.00	0.45	-17.63	-19.42	-20.15	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-24.00	-0.05	-23.92	-25.40	-24.91	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.50	0.05	-32.61	-33.10	-32.53	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-33.75	-0.05	-33.77	-35.18	-35.11	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-23.20	-0.45	-23.28	-24.70	-26.12	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-72.75	-0.50
-76.50	-1.50
-79.25	-3.00
-79.50	-2.75
-80.50	-2.75
-81.00	-2.75
-80.50	-1.75
-67.25	-1.25

CRS

USD/KRW 1117.20 (+9.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1150	-1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	7.50	-3.00
1.5Y	1.1550	-2.50	1.6600	0.8100	2*3Y	7.00	0.00
2Y	1.1900	-4.00	1.6950	0.8650	2*5Y	15.00	0.00
3Y	1.2600	-4.00	1.7550	0.9550	3*4Y	4.50	0.00
4Y	1.3050	-4.00	1.8000	1.0150	3*5Y	8.00	0.00
5Y	1.3400	-4.00	1.8500	1.0350	4*5Y	3.50	0.00
7Y	1.3900	-3.00	1.8950	1.0400	5*7Y	5.00	1.00
10Y	1.5900	-2.50	2.0500	1.0500	5*10Y	25.00	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	2.5371	-0.0041	2.5412	2.5369	2.5659	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.8842	-0.0119	2.8961	2.8980	2.9374	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	44.91	0.19	44.72	44.59	46.59	46.59	-53.43	46.59	-251.80
10Y	28.42	0.01	28.41	30.30	32.54	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	28.00	-0.25	28.25	27.00	27.50	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	51.20	-0.60	51.80	50.40	51.20	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	34.71	-0.78	35.49	36.11	37.15	127.76	34.55	242.00	34.55

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	72.25	ODD Tenor	
09M			
01Y	84.25 / 84		
1.5Y	92.25		
02Y	98.5	SPRD	3*5Y 9.5
03Y	5.75 / 06		
04Y			
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1Y CCS 14 2y CCS 21.5 5y CCS 34.5 / 33.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	45 건	-79	124	80	124	105	73	128
금 액	30,780 억원	-14,530	45,310	24,520	52,620	29,350	14,935	40,328

장중동향

국고채 금리, 아시아 시장에서 미 국채금리 하락에 연동되며 금리 하락.

IRS, 금리 전반적 소폭 하락.
거래량이 많지 않은 가운데 2Y,3Y 위주로 테이큰 되는 양상.

CRS, 2Y-5Y 구간을 중심으로 금리 하락.