IPS Daily Morning Brief

2018-06-29

종가 기준일 2018-06-28

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7075	0.25	1.7160	1.7219	1.7252	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7775	0.00	1.7875	1.7975	1.7942	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8200	-0.50	1.8350	1.8496	1.8532	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.8925	-0.25	1.9115	1.9345	1.9488	2.0250	1.4700	2.7700	1.1900
2Y	1.9550	-0.50	1.9750	2.0041	2.0224	2.1150	1.5000	2.8275	1.1675
3Y	2.0275	-0.50	2.0485	2.0923	2.1169	2.2225	1.5550	2.9250	1.1550
4Y	2.0775	-1.00	2.1030	2.1556	2.1813	2.2950	1.6050	3.0150	1.1575
5Y	2.1125	-0.75	2.1405	2.1994	2.2260	2.3400	1.6475	3.0950	1.1575
7Y	2.1525	-0.75	2.1835	2.2474	2.2751	2.3950	1.7050	3.2175	1.1675
10Y	2.2125	-0.75	2.2480	2.3158	2.3445	2.4850	1.7825	3.3450	1.2125
12Y	2.2525	-0.75	2.2880	2.3558	2.3864	2.5225	1.8175	3.3850	1.2150
15Y	2.2800	-0.75	2.3155	2.3833	2.4099	2.5400	1.8250	3.4125	1.2150
20Y	2.3100	-0.75	2.3485	2.4145	2.4370	2.5600	1.8250	3.5325	1.2150

6*9M	7.00	-0.25	7.15	7.56	6.90	12.50	0.00	12.50	-6.00
9*12M	4.25	-0.50	4.75	5.21	5.90	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	13.50	0.00	14.00	15.45	16.92	23.00	3.50	23.00	-5.50
2*3Y	7.25	0.00	7.35	8.81	9.45	13.25	4.75	13.25	-1.75
2*4Y	12.25	-0.50	12.80	15.15	15.90	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	15.75	-0.25	16.55	19.53	20.36	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	5.00	-0.50	5.45	6.34	6.44	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	8.50	-0.25	9.20	10.71	10.90	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.25	3.75	4.38	4.46	6.00	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.00	4.30	4.80	4.91	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	10.00	0.00	10.75	11.64	11.85	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.00	0.00	6.45	6.84	6.94	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.00	4.20	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.00	6.75	6.75	6.54	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.00	10.05	9.88	9.26	10.25	-6.25	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.862	-1.00	1.877	1.866	1.860	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.975	-0.40	1.990	2.010	2.019	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.059	-0.80	2.080	2.106	2.126	2.230	1.577	2.818	1.225
3Y	2.115	-0.50	2.132	2.178	2.208	2.315	1.617	2.913	1.200
4Y	2.245	-1.00	2.272	2.344	2.381	2.502	1.755	3.125	1.232
5Y	2.351	-1.40	2.381	2.450	2.476	2.602	1.805	3.208	1.217
7Y	2.481	-1.40	2.511	2.579	2.602	2.728	2.024	3.370	1.270
10Y	2.560	-1.50	2.591	2.666	2.696	2.815	2.115	3.585	1.355
20Y	2.560	-1.20	2.587	2.658	2.696	2.792	2.175	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	108.06	0.01	108.08	108.11	108.01
LKTB	121.16	0.07	121.20	121.37	121.05

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	-4.20	0.50	-4.18	-1.64	-0.72	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-8.25	0.15	-7.89	-7.51	-7.04	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.40	0.30	-10.46	-10.22	-10.38	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-8.75	0.00	-8.33	-8.60	-9.08	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-16.75	0.00	-16.94	-18.81	-19.92	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-23.85	0.65	-24.01	-25.02	-24.99	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.85	0.65	-32.77	-33.13	-32.66	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-34.75	0.75	-34.28	-35.02	-35.19	-24.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-25.00	0.45	-23.83	-24.30	-25.93	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-68.00	0.00
-73.25	-0.25
-76.50	0.00
-77.75	-0.50
-78.75	-0.50
-78.25	-0.25
-74.25	-0.25
-54.75	4.25

CRS

USD/KRW 1124.20 (+6.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1400	-0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	5.00	0.00
1.5Y	1.1600	-0.50	1.6600	0.8100	2*3Y	6.00	-0.50
2Y	1.1900	-0.50	1.6950	0.8650	2*5Y	14.00	-0.50
3Y	1.2500	-1.00	1.7550	0.9550	3*4Y	4.00	-0.50
4Y	1.2900	-1.50	1.8000	1.0150	3*5Y	8.00	0.00
5Y	1.3300	-1.00	1.8500	1.0350	4*5Y	4.00	0.50
7Y	1.4100	-1.00	1.8950	1.0400	5*7Y	8.00	0.00
10Y	1.6650	3.50	2.0500	1.0500	5*10Y	33.50	4.50

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	2.5120	0.0167	2.4953	2.5287	2.5371	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.8386	0.0127	2.8259	2.8842	2.8842	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	45.30	2.47	42.83	43.87	44.91	46.59	-53.43	46.59	-251.80
10Y	27.86	2.77	25.09	27.72	28.42	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	25.75	-0.25	26.00	28.50	28.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTB 2*10Y	50.10	-0.70	50.80	51.70	51.20	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	32.66	-0.40	33.06	35.55	34.71	127.00	32.66	242.00	32.66

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			9y 18.5 / 18.75 / 19
06M	70.5	ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	94.75	SPRD	2*4y 12.25
03Y			5*9y 7.75
04Y	07 / 8.25		10*20y 9.75
05Y	11.25		
07Y	15.25		
10Y	21.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	100 건	0	100	63	45	124	80	124
금 액	27,805 억원	2,417	25,388	15,275	30,780	45,310	24,520	52,620

장중동향

채권 강세, 금리 하락마감.

계속되는 무역분쟁에따른 안전자산 선호분위기속에 반기말 윈도드레싱으로 강세. 외국인의 꾸준한 매수.

IRS도 현선물과 연동하며 6개월, 9개월을 제외하고 하락 마감.

1년부터 오퍼리시했고, 전일부터 이어진 구조화물량으로 장기 스프레드거래도 활발.

CRS도 전구간 하락 마감.