

IPS Daily Morning Brief

2018-05-04

종가 기준일 2018-05-03

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7425	0.75	1.7325	1.7261	1.7178	1.7450	1.3900	2.6700	1.2875
9M	1.8025	0.75	1.7940	1.7844	1.7799	1.8125	1.4100	2.6925	1.2500
1Y	1.8650	1.00	1.8550	1.8423	1.8403	1.8850	1.4350	2.7225	1.2200
1.5Y	1.9700	1.25	1.9540	1.9361	1.9458	2.0050	1.4625	2.7875	1.1900
2Y	2.0475	1.25	2.0290	2.0058	2.0260	2.1000	1.4700	2.8525	1.1675
3Y	2.1500	1.25	2.1290	2.0990	2.1310	2.2175	1.5050	2.9825	1.1550
4Y	2.2250	1.25	2.2010	2.1605	2.1986	2.2950	1.5625	3.1075	1.1575
5Y	2.2750	1.25	2.2470	2.2046	2.2453	2.3400	1.6125	3.2125	1.1575
7Y	2.3275	1.25	2.2980	2.2514	2.2975	2.3950	1.6825	3.3550	1.1675
10Y	2.3950	1.00	2.3660	2.3211	2.3720	2.4850	1.7725	3.4975	1.2125
12Y	2.4400	1.00	2.4110	2.3661	2.4150	2.5225	1.8000	3.5375	1.2150
15Y	2.4600	1.00	2.4310	2.3861	2.4343	2.5400	1.7900	3.5550	1.2150
20Y	2.4825	1.00	2.4535	2.4086	2.4548	2.5600	1.7000	3.7050	1.2150

6*9M	6.00	0.00	6.15	5.83	6.22	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	6.25	0.25	6.10	5.79	6.04	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	18.25	0.25	17.40	16.35	18.57	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.25	0.00	10.00	9.32	10.50	13.25	3.50	13.75	-1.75
2*4Y	17.75	0.00	17.20	15.48	17.25	21.75	8.50	27.75	-1.75
2*5Y	22.75	0.00	21.80	19.89	21.93	27.25	11.75	38.50	-1.75
3*4Y	7.50	0.00	7.20	6.15	6.75	8.50	3.25	14.00	-0.50
3*5Y	12.50	0.00	11.80	10.56	11.43	14.00	6.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.00	0.00	4.60	4.41	4.67	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	5.25	0.00	5.10	4.68	5.21	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	12.00	-0.25	11.90	11.65	12.67	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	-0.25	6.80	6.98	7.45	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.50	4.30	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.50	6.23	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.75	8.28	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.836	0.20	1.839	1.847	1.877	1.935	1.400	2.696	1.237
1.5Y	2.027	1.50	2.012	2.006	2.038	2.108	1.517	2.763	1.232
2Y	2.160	1.80	2.132	2.115	2.154	2.230	1.560	2.840	1.225
3Y	2.250	1.30	2.221	2.196	2.241	2.315	1.600	2.930	1.200
4Y	2.433	1.60	2.401	2.371	2.408	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.533	1.60	2.495	2.447	2.485	2.602	1.770	3.320	1.217
7Y	2.657	1.20	2.622	2.574	2.617	2.728	1.965	3.510	1.270
10Y	2.757	1.00	2.722	2.668	2.705	2.812	2.047	3.700	1.355
20Y	2.762	0.10	2.728	2.679	2.704	2.792	2.110	3.905	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.61	-0.06	107.69	107.71	107.61
LKTB	119.30	-0.13	119.54	119.60	119.30

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	2.90	0.80	1.62	-0.46	-3.64	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-5.70	-0.25	-5.78	-6.99	-9.22	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-11.25	-0.55	-10.34	-10.89	-12.83	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-10.00	-0.05	-9.18	-9.66	-11.02	4.75	-14.95	8.75	-19.50
4Y	-20.80	-0.35	-20.02	-21.02	-20.97	-8.50	-30.00	2.00	-30.35
5Y	-25.80	-0.35	-24.78	-24.22	-23.98	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.95	0.05	-32.38	-32.24	-31.91	-21.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-36.20	0.00	-35.62	-34.66	-33.28	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-27.95	0.90	-27.43	-27.05	-24.92	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1076.30 (+0.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-76.00	-0.50	1Y	1.1050	0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	7.00	0.00		
-82.50	-0.75	1.5Y	1.1450	0.50	1.6600	0.8100	2*3Y	7.00	0.00		
-87.25	-0.75	2Y	1.1750	0.50	1.6950	0.8650	2*5Y	19.00	-0.50		
-90.50	-0.75	3Y	1.2450	0.50	1.7550	0.9550	3*4Y	6.00	0.00		
-92.00	-0.75	4Y	1.3050	0.50	1.8000	1.0150	3*5Y	12.00	-0.50		
-91.00	-1.25	5Y	1.3650	0.00	1.8500	1.0350	4*5Y	6.00	-0.50		
-80.75	-0.75	7Y	1.5200	0.50	1.8950	1.0400	5*7Y	15.50	0.50		
-64.50	-0.50	10Y	1.7500	0.50	2.0500	1.0500	5*10Y	38.50	0.50		

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	2.4762	-0.0120	2.4882	2.5083	2.4920	2.5083	1.1000	2.5083	0.3000
10Y	2.9490	-0.0196	2.9686	2.9667	2.9526	3.0282	2.0387	3.0300	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	31.62	-3	34.62	38.23	37.50	38.23	-59.60	38.23	-251.80
10Y	19.20	-2.96	22.16	24.97	25.76	47.40	-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	34.75	-0.25	35.00	33.25	32.75	42.50	19.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	59.70	-0.80	60.50	59.10	57.80	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	47.28	-0.76	48.04	45.84	46.06	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6Y 28 / 28.5						
06M									
09M									
01Y	85.5								
1.5Y	95.25 / 95.75								
02Y		SPRD	2*3Y 10						
03Y	13.5 / 15		2*5Y 22.5						
04Y	22 / 22.5		3*4Y 7.5						
05Y	25 / 25.75		3*5Y 12.25						
07Y			3*6Y 15.5						
10Y	38.25 / 39.5		4*5Y 4.75						
12Y			5*6Y 03						
15Y									
20Y									
CRS	7Y CCS 54								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	107 건		25	82	38	55	55	88	139
금 액	31,558 억원		11,443	20,115	15,520	15,075	15,075	25,285	44,243

장중동향
국고채 금리, 장 막판 외인 매도세에 금리 상승 마감.

IRS, 금리 상승 마감.
1.5년을 중심으로 거래 다수. 막판 국채선물이 밀리자 비드가 많이 출현.

CRS, 5년을 제외한 구간에서 고르게 금리 상승.