

IPS Daily Morning Brief

2018-05-08

종가 기준일 2018-05-07

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7550	1.25	1.7410	1.7309	1.7195	1.7550	1.3900	2.6700	1.2875
9M	1.8175	1.50	1.8020	1.7894	1.7815	1.8175	1.4100	2.6925	1.2500
1Y	1.8800	1.50	1.8640	1.8488	1.8418	1.8850	1.4350	2.7225	1.2200
1.5Y	1.9900	2.00	1.9680	1.9443	1.9466	2.0050	1.4625	2.7875	1.1900
2Y	2.0675	2.00	2.0450	2.0154	2.0264	2.1000	1.4700	2.8525	1.1675
3Y	2.1700	2.00	2.1470	2.1104	2.1309	2.2175	1.5050	2.9825	1.1550
4Y	2.2425	1.75	2.2205	2.1734	2.1984	2.2950	1.5625	3.1075	1.1575
5Y	2.2925	1.75	2.2695	2.2180	2.2449	2.3400	1.6125	3.2125	1.1575
7Y	2.3400	1.25	2.3205	2.2645	2.2965	2.3950	1.6825	3.3550	1.1675
10Y	2.4050	1.00	2.3880	2.3341	2.3703	2.4850	1.7725	3.4975	1.2125
12Y	2.4500	1.00	2.4330	2.3791	2.4135	2.5225	1.8000	3.5375	1.2150
15Y	2.4700	1.00	2.4530	2.3991	2.4329	2.5400	1.7900	3.5550	1.2150
20Y	2.4925	1.00	2.4755	2.4216	2.4536	2.5600	1.7000	3.7050	1.2150

6*9M	6.25	0.25	6.10	5.85	6.20	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	6.25	0.00	6.20	5.94	6.03	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	18.75	0.50	18.10	16.66	18.46	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.25	0.00	10.20	9.50	10.45	13.25	3.50	13.75	-1.75
2*4Y	17.50	-0.25	17.55	15.80	17.20	21.75	8.50	27.75	-1.75
2*5Y	22.50	-0.25	22.45	20.26	21.85	27.25	11.75	38.50	-1.75
3*4Y	7.25	-0.25	7.35	6.30	6.75	8.50	3.25	14.00	-0.50
3*5Y	12.25	-0.25	12.25	10.76	11.40	14.00	6.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.00	0.00	4.90	4.46	4.65	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	-0.50	5.10	4.65	5.16	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.25	-0.75	11.85	11.61	12.54	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	-0.25	6.75	6.96	7.38	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.50	4.33	4.50	1.25	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.50	6.26	6.50	1.00	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.75	8.33	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.847	1.10	1.837	1.846	1.876	1.935	1.400	2.696	1.237
1.5Y	2.054	2.70	2.025	2.010	2.037	2.108	1.517	2.763	1.232
2Y	2.183	2.30	2.154	2.122	2.154	2.230	1.560	2.840	1.225
3Y	2.280	3.00	2.247	2.206	2.240	2.315	1.600	2.930	1.200
4Y	2.455	2.20	2.427	2.382	2.408	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.555	2.20	2.526	2.462	2.485	2.602	1.770	3.320	1.217
7Y	2.669	1.20	2.649	2.588	2.616	2.728	1.965	3.510	1.270
10Y	2.762	0.50	2.748	2.683	2.704	2.812	2.047	3.700	1.355
20Y	2.762	0.00	2.754	2.693	2.705	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	107.52	-0.09	107.65	107.66	107.49
LKTb	119.25	-0.05	119.51	119.53	119.14

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	3.30	0.40	2.66	0.26	-3.41	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-6.40	-0.70	-5.68	-6.62	-9.03	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-11.55	-0.30	-10.92	-10.70	-12.72	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-11.00	-1.00	-9.98	-9.51	-10.93	4.75	-14.95	7.25	-19.50
4Y	-21.25	-0.45	-20.63	-20.86	-21.00	-8.50	-27.75	2.00	-30.35
5Y	-26.25	-0.45	-25.61	-24.38	-24.00	-9.60	-27.20	4.55	-27.25
7Y	-32.90	0.05	-32.85	-32.38	-31.90	-21.90	-35.65	-3.75	-37.65
10Y	-35.70	0.50	-36.00	-34.89	-33.35	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.95	1.00	-27.83	-27.13	-25.10	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1077.20 (+0.90)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-81.00	-5.00	1Y	1.0700	-3.50	1.6200	0.7650	1*2Y	7.00	0.00
-88.00	-5.50	1.5Y	1.1100	-3.50	1.6600	0.8100	2*3Y	7.50	0.50
-92.75	-5.50	2Y	1.1400	-3.50	1.6950	0.8650	2*5Y	19.50	0.50
-95.50	-5.00	3Y	1.2150	-3.00	1.7550	0.9550	3*4Y	6.00	0.00
-96.75	-4.75	4Y	1.2750	-3.00	1.8000	1.0150	3*5Y	12.00	0.00
-95.75	-4.75	5Y	1.3350	-3.00	1.8500	1.0350	4*5Y	6.00	0.00
-85.00	-4.25	7Y	1.4900	-3.00	1.8950	1.0400	5*7Y	15.50	0.00
-67.50	-3.00	10Y	1.7300	-2.00	2.0500	1.0500	5*10Y	39.50	1.00

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	2.5052	0.0002	2.5050	2.4762	2.4882	2.5083	1.1000	2.5083	0.3000
10Y	2.9520	0.0010	2.9510	2.9490	2.9686	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	32.22	-2.28	34.50	31.62	34.62	38.23	-59.60	38.23	-251.80
10Y	19.00	-0.40	19.40	19.20	22.16	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	33.75	-1.00	34.75	34.75	35.00	42.50	19.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	57.90	-1.80	59.70	59.70	60.50	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	44.68	0.08	44.60	47.28	48.04	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M									
09M									
01Y	87 / 87.5 / 88 / 88.75								
1.5Y	97 / 98.5 / 98.75								
02Y	06 / 6.25 / 6.75		SPRD	1.5*2Y 7.75 / 9.75					
03Y	16.75			7*12Y 11					
04Y									
05Y	27.5 / 27.75 / 28.25 / 29.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	141 건	34	107	107	82	38	55	55	
금 액	40,291 억원	8,733	31,558	31,558	20,115	15,520	15,075	15,075	

장중동향
국고채 금리, 외인의 3년 선물 매도&5월 소수의견 우려에 단기물음 중심으로 금리 상승.

IRS, 금리 상승. 커브 플랫트닝.
5월 금통위에서 소수 의견이 나올 수 있다는 전망이 늘면서 단기쪽 비드 우세.
1.5~5Y 구간을 중심으로 기본되며 거래. 장기구간은 비드가 나오자 오퍼가 따라나오는 분위기.

CRS, 금리 하락 마감. 거래는 거의 이루어지지 않은 채 스크린 금리만 빠지는 모습.
에셋스왑이 1Y~3Y 구간으로 꾸준히 나옴.