

IPS Daily Morning Brief

2018-05-10

종가 기준일 2018-05-09

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7500	-0.25	1.7510	1.7368	1.7218	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.8275	0.25	1.8180	1.7968	1.7842	1.8275	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8950	0.25	1.8825	1.8574	1.8444	1.8950	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	2.0150	0.50	1.9950	1.9559	1.9494	2.0150	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.0900	0.50	2.0715	2.0285	2.0286	2.1000	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.1975	1.00	2.1750	2.1254	2.1328	2.2175	1.5050	2.9275	1.1550
4Y	2.2675	1.25	2.2465	2.1901	2.1999	2.2950	1.5625	3.0575	1.1575
5Y	2.3125	1.00	2.2950	2.2353	2.2460	2.3400	1.6125	3.1675	1.1575
7Y	2.3600	1.00	2.3435	2.2818	2.2970	2.3950	1.6825	3.3125	1.1675
10Y	2.4250	1.25	2.4085	2.3506	2.3698	2.4850	1.7725	3.4600	1.2125
12Y	2.4675	1.00	2.4530	2.3955	2.4133	2.5225	1.8000	3.5000	1.2150
15Y	2.4875	1.00	2.4730	2.4155	2.4328	2.5400	1.7900	3.5175	1.2150
20Y	2.5100	1.00	2.4955	2.4380	2.4535	2.5600	1.7000	3.6675	1.2150

6*9M	7.75	0.50	6.70	6.00	6.23	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	6.75	0.00	6.45	6.06	6.03	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	19.50	0.25	18.90	17.11	18.42	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.75	0.50	10.35	9.69	10.42	13.25	3.50	13.75	-1.75
2*4Y	17.75	0.75	17.50	16.16	17.13	21.75	8.50	27.75	-1.75
2*5Y	22.25	0.50	22.35	20.68	21.74	27.25	11.75	38.50	-1.75
3*4Y	7.00	0.25	7.15	6.48	6.71	8.50	3.25	14.00	-0.50
3*5Y	11.50	0.00	12.00	10.99	11.32	14.00	6.00	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	-0.25	4.85	4.51	4.61	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	4.85	4.65	5.10	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.25	0.25	11.35	11.54	12.38	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.25	6.50	6.89	7.28	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.25	-0.25	4.45	4.49	4.35	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.25	-0.25	6.45	6.49	6.29	6.50	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.50	-0.25	8.70	8.74	8.37	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.894	1.00	1.862	1.850	1.877	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.088	0.60	2.061	2.019	2.038	2.108	1.517	2.750	1.232
2Y	2.205	-0.40	2.188	2.135	2.155	2.230	1.560	2.830	1.225
3Y	2.300	-0.20	2.282	2.220	2.242	2.315	1.600	2.920	1.200
4Y	2.471	-0.10	2.457	2.397	2.411	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.575	0.00	2.559	2.481	2.487	2.602	1.770	3.283	1.217
7Y	2.697	1.20	2.675	2.607	2.616	2.728	1.965	3.487	1.270
10Y	2.800	2.40	2.771	2.703	2.705	2.812	2.047	3.680	1.355
20Y	2.780	1.40	2.766	2.709	2.706	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	107.47	-0.01	107.76	107.52	107.43
LKTb	118.91	-0.24	119.10	119.15	118.83

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	0.10	-0.75	2.09	0.71	-3.24	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.30	-0.10	-6.60	-6.35	-8.90	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-11.50	0.90	-11.65	-10.64	-12.66	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-10.25	1.20	-10.74	-9.49	-10.91	4.75	-14.95	5.75	-19.50
4Y	-20.35	1.35	-21.07	-20.72	-21.07	-8.50	-25.70	2.00	-30.35
5Y	-26.25	1.00	-26.36	-24.56	-24.08	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.70	-0.20	-33.19	-32.48	-31.94	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-37.50	-1.15	-36.29	-35.20	-33.49	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-27.00	-0.40	-27.09	-27.09	-25.26	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1080.90 (+4.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-80.00	-1.25	1Y	1.0950	-1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	4.50	-1.50	
-89.50	-2.50	1.5Y	1.1200	-2.00	1.6600	0.8100	2*3Y	7.00	-0.50	
-95.00	-3.00	2Y	1.1400	-2.50	1.6950	0.8650	2*5Y	18.50	-0.50	
-98.75	-4.00	3Y	1.2100	-3.00	1.7550	0.9550	3*4Y	5.00	0.00	
-100.75	-4.25	4Y	1.2600	-3.00	1.8000	1.0150	3*5Y	11.50	0.00	
-98.75	-4.00	5Y	1.3250	-3.00	1.8500	1.0350	4*5Y	6.50	0.00	
-87.50	-3.50	7Y	1.4850	-2.50	1.8950	1.0400	5*7Y	16.00	0.50	
-70.50	-3.75	10Y	1.7200	-2.50	2.0500	1.0500	5*10Y	39.50	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	2.5341	0.0206	2.5135	2.5052	2.5050	2.5341	1.1000	2.5341	0.3000
10Y	2.9783	0.0000	2.9783	2.9520	2.9510	3.0282	2.0387	3.0282	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	32.91	2.46	30.45	32.22	32.20	38.23	-58.90	38.23	-251.80
10Y	17.83	-2.40	20.23	19.00	18.90	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	33.50	0.75	32.75	33.75	33.75	42.50	19.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	59.50	2.80	56.70	57.90	57.90	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	44.42	-2.06	46.48	44.68	44.60	135.50	41.06	260.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y	89.25 / 89.5								
1.5Y	1.25								
02Y	8.25 / 8.5 / 8.75 / 09 / 9.25								
03Y					SPRD				
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	77 건		-34	111	141	141	107	82	38
금 액	36,688 억원		-10,492	47,180	40,291	40,291	31,558	20,115	15,520

장종동향

채권 장기중심으로 금리상승.

중단기 강보합 장기 약세 마감. 미금리 상승과 외인의 매도세로 약보합을 보이던 채권은 금통위원의 발언으로 오후 한때 강세 시도, 재차 하락하면서 장기물을 중심으로 약세 압박.

IRS 레벨 상승.

1년에서 2년 구간과 5년에 비드 수요가 많이 나오며 거래. 장 후반 국채선물이 하락하면서 연동해 레벨 상승마감.