

IPS Daily Morning Brief

2018-05-11

종가 기준일 2018-05-10

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7450	-0.50	1.7515	1.7375	1.7227	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.8250	-0.25	1.8225	1.7990	1.7853	1.8275	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8950	0.00	1.8885	1.8608	1.8456	1.8950	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	2.0075	-0.75	2.0025	1.9606	1.9505	2.0150	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.0800	-1.00	2.0780	2.0341	2.0295	2.1000	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.1775	-2.00	2.1805	2.1319	2.1333	2.2175	1.5050	2.9275	1.1550
4Y	2.2450	-2.25	2.2505	2.1976	2.2003	2.2950	1.5625	3.0550	1.1575
5Y	2.2900	-2.25	2.2980	2.2431	2.2462	2.3400	1.6125	3.1675	1.1575
7Y	2.3375	-2.25	2.3455	2.2900	2.2970	2.3950	1.6825	3.3125	1.1675
10Y	2.4075	-1.75	2.4110	2.3589	2.3695	2.4850	1.7725	3.4600	1.2125
12Y	2.4475	-2.00	2.4545	2.4035	2.4130	2.5225	1.8000	3.5000	1.2150
15Y	2.4675	-2.00	2.4745	2.4235	2.4325	2.5400	1.7900	3.5175	1.2150
20Y	2.4900	-2.00	2.4970	2.4460	2.4533	2.5600	1.7000	3.6675	1.2150

6*9M	8.00	0.25	7.10	6.15	6.26	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	7.00	0.25	6.60	6.18	6.03	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	18.50	-1.00	18.95	17.34	18.39	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	9.75	-1.00	10.25	9.78	10.39	13.25	3.50	13.50	-1.75
2*4Y	16.50	-1.25	17.25	16.35	17.08	21.75	8.50	27.25	-1.75
2*5Y	21.00	-1.25	22.00	20.90	21.67	27.25	11.75	38.50	-1.75
3*4Y	6.75	-0.25	7.00	6.58	6.69	8.50	3.25	13.75	-0.50
3*5Y	11.25	-0.25	11.75	11.13	11.28	14.00	6.00	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.75	4.55	4.59	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	4.75	4.69	5.08	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.75	0.50	11.30	11.58	12.33	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.50	6.55	6.89	7.25	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	-0.25	4.35	4.46	4.35	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.00	-0.25	6.35	6.46	6.30	6.50	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.25	-0.25	8.60	8.71	8.38	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.900	0.60	1.874	1.853	1.877	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.083	-0.50	2.072	2.023	2.039	2.108	1.517	2.750	1.232
2Y	2.182	-2.30	2.192	2.140	2.155	2.230	1.560	2.830	1.225
3Y	2.275	-2.50	2.287	2.227	2.242	2.315	1.600	2.920	1.200
4Y	2.450	-2.10	2.461	2.404	2.411	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.555	-2.00	2.563	2.490	2.487	2.602	1.770	3.283	1.217
7Y	2.676	-2.10	2.679	2.616	2.617	2.728	1.965	3.487	1.270
10Y	2.777	-2.30	2.775	2.713	2.705	2.812	2.047	3.680	1.355
20Y	2.762	-1.80	2.766	2.718	2.707	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	107.55	0.08	107.46	107.57	107.46
LKTb	119.15	0.24	118.87	119.27	118.87

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	-0.50	-0.60	1.41	0.78	-3.18	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.55	-0.25	-6.97	-6.26	-8.84	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.20	1.30	-11.44	-10.60	-12.60	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-9.75	0.50	-10.69	-9.46	-10.88	4.75	-14.95	5.00	-19.50
4Y	-20.50	-0.15	-21.01	-20.66	-21.11	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-26.50	-0.25	-26.50	-24.67	-24.13	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.85	-0.15	-33.37	-32.55	-31.96	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-36.95	0.55	-36.44	-35.38	-33.57	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-27.20	-0.20	-26.94	-27.17	-25.35	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1073.10 (-7.80)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-78.50	1.50	1Y	1.1100	1.50	1.6200	0.7650	1*2Y	4.00	-0.50		
-87.75	1.75	1.5Y	1.1300	1.00	1.6600	0.8100	2*3Y	7.00	0.00		
-93.00	2.00	2Y	1.1500	1.00	1.6950	0.8650	2*5Y	18.00	-0.50		
-95.75	3.00	3Y	1.2200	1.00	1.7550	0.9550	3*4Y	5.00	0.00		
-97.50	3.25	4Y	1.2700	1.00	1.8000	1.0150	3*5Y	11.00	-0.50		
-96.00	2.75	5Y	1.3300	0.50	1.8500	1.0350	4*5Y	6.00	-0.50		
-84.75	2.75	7Y	1.4900	0.50	1.8950	1.0400	5*7Y	16.00	0.00		
-68.25	2.25	10Y	1.7250	0.50	2.0500	1.0500	5*10Y	39.50	0.00		

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	2.5261	-0.0080	2.5341	2.5135	2.5052	2.5341	1.1000	2.5341	0.3000
10Y	2.9649	-0.0407	3.0056	2.9783	2.9520	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	34.41	1.5	32.91	30.45	32.22	38.23	-57.30	38.23	-251.80
10Y	18.79	-1.77	20.56	20.23	19.00	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	32.75	-0.75	33.50	32.75	33.75	42.50	19.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	59.50	0.00	59.50	56.70	57.90	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	43.88	-3.27	47.15	46.48	44.68	135.50	41.06	256.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6Y 31.75						
06M									
09M									
01Y	89								
1.5Y	01								
02Y	7.75	SPRD	1*2Y 18.5						
03Y	18 / 18.25 / 19.25		1*3Y 28						
04Y			5*10Y 11 / 11.25						
05Y	29 / 30 / 30.5								
07Y									
10Y	41.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y CCS 22 / 23 / 24								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	96 건	19	77	111	141	141	107	82	
금 액	28,403 억원	-8,285	36,688	47,180	40,291	40,291	31,558	20,115	

장중동향
국고채 금리, 아시아장 美 금리 내림세와 함께 금리 하락.

IRS, 아시아장 美 금리 하락이 매수심리를 자극해 저가 매수 유입되며 IRS 금리 하락. 1Y은 보합.
3Y-6Y 구간을 중심으로 활기. 국채선물 상승하면서 기본 되며 거래되는 양상.

CRS, 스왑베이스스가 큰 폭으로 벌어진 후 비드가 유입되면서 금리 상승.