IPS Daily Morning Brief

2018-05-14

종가 기준일 2018-05-11

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7450	0.00	1.7495	1.7385	1.7236	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.8275	0.25	1.8245	1.8015	1.7865	1.8275	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.9000	0.50	1.8925	1.8641	1.8468	1.9000	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	2.0100	0.25	2.0065	1.9651	1.9517	2.0150	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.0875	0.75	2.0820	2.0396	2.0304	2.1000	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.1850	0.75	2.1835	2.1379	2.1340	2.2175	1.5050	2.9275	1.1550
4Y	2.2525	0.75	2.2525	2.2045	2.2008	2.2950	1.5625	3.0550	1.1575
5Y	2.2975	0.75	2.2990	2.2503	2.2465	2.3400	1.6125	3.1675	1.1575
7Y	2.3450	0.75	2.3465	2.2974	2.2970	2.3950	1.6825	3.3125	1.1675
10Y	2.4150	0.75	2.4130	2.3661	2.3692	2.4850	1.7725	3.4600	1.2125
12Y	2.4550	0.75	2.4555	2.4105	2.4128	2.5225	1.8000	3.5000	1.2150
15Y	2.4750	0.75	2.4755	2.4305	2.4323	2.5400	1.7900	3.5175	1.2150
20Y	2.4975	0.75	2.4980	2.4530	2.4532	2.5600	1.7000	3.6675	1.2150

6*9M	8.25	0.25	7.50	6.30	6.29	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	7.25	0.25	6.80	6.26	6.04	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	18.75	0.25	18.95	17.55	18.36	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	9.75	0.00	10.15	9.83	10.36	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	16.50	0.00	17.05	16.49	17.03	21.75	8.50	26.50	-1.75
2*5Y	21.00	0.00	21.70	21.06	21.60	27.25	11.75	37.75	-1.75
3*4Y	6.75	0.00	6.90	6.66	6.68	8.50	3.25	13.50	-0.50
3*5Y	11.25	0.00	11.55	11.24	11.25	14.00	6.00	24.50	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.65	4.58	4.57	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	4.75	4.71	5.06	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.75	0.00	11.40	11.59	12.28	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.00	6.65	6.88	7.22	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.25	4.44	4.35	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.00	0.00	6.25	6.44	6.31	6.50	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.25	0.00	8.50	8.69	8.40	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.903	0.30	1.886	1.856	1.878	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.098	1.50	2.081	2.029	2.040	2.108	1.517	2.750	1.232
2Y	2.190	0.80	2.194	2.146	2.156	2.230	1.560	2.830	1.225
3Y	2.282	0.70	2.288	2.233	2.242	2.315	1.600	2.920	1.200
4Y	2.456	0.60	2.461	2.411	2.412	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.560	0.50	2.564	2.499	2.488	2.602	1.770	3.283	1.217
7Y	2.681	0.50	2.682	2.624	2.617	2.728	1.965	3.487	1.270
10Y	2.785	0.80	2.780	2.722	2.706	2.812	2.047	3.680	1.355
20Y	2.762	0.00	2.766	2.726	2.708	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	-0.03	107.57	107.59	107.50
LKTB	119.07	-0.08	119.20	119.24	119.03

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	-0.30	0.20	0.69	0.78	-3.12	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-8.80	-1.25	-7.45	-6.34	-8.79	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.25	-0.05	-11.18	-10.62	-12.54	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-9.70	0.05	-10.43	-9.50	-10.84	4.75	-14.95	5.00	-19.50
4Y	-20.35	0.15	-20.83	-20.65	-21.14	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-26.25	0.25	-26.50	-24.84	-24.17	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.60	0.25	-33.51	-32.64	-31.99	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-37.00	-0.05	-36.70	-35.54	-33.65	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.45	0.75	-26.84	-27.26	-25.44	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-81.00	-2.50
-88.00	-0.25
-93.25	-0.25
-96.50	-0.75
-98.25	-0.75
-97.25	-1.25
-86.00	-1.25
-69.50	-1.25

CRS

USD/KRW 1069.30 (-3.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.0900	-2.00	1.6200	0.7650	1*2Y	6.50	2.50
1.5Y	1.1300	0.00	1.6600	0.8100	2*3Y	6.50	-0.50
2Y	1.1550	0.50	1.6950	0.8650	2*5Y	17.00	-1.00
3Y	1.2200	0.00	1.7550	0.9550	3*4Y	5.00	0.00
4Y	1.2700	0.00	1.8000	1.0150	3*5Y	10.50	-0.50
5Y	1.3250	-0.50	1.8500	1.0350	4*5Y	5.50	-0.50
7Y	1.4850	-0.50	1.8950	1.0400	5*7Y	16.00	0.00
10Y	1.7200	-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	2.5390	0.0129	2.5261	2.5341	2.5135	2.5390	1.1120	2.5390	0.3000
10Y	2.9695	0.0046	2.9649	3.0056	2.9783	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	34.90	0.49	34.41	32.91	30.45	38.23	-57.30	38.23	-251.80
10Y	18.45	-0.34	18.79	20.56	20.23	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	0.00	32.75	33.50	32.75	42.50	19.50	67.75	2.75
KTB 2*10Y	59.50	0.00	59.50	59.50	56.70	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	43.05	-0.83	43.88	47.15	46.48	135.50	41.06	256.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	74	ODD Tenor	
09M			
01Y	90		
1.5Y			
02Y	8.25	SPRD	6*9M 08
03Y			6*12M 15
04Y			1*2Y 18.5
05Y	29.25		2*5Y 21
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	83 건	-13	96	77	111	141	141	107
금 액	30,148 억원	1,745	28,403	36,688	47,180	40,291	40,291	31,558

장중동향

국고채 금리, 상승.

오전 국채선물은 미 금리 하락에 강보합으로 출발한 후 보합권 등락이 나타났지만, 오후들어 외국인이 10년 국채선물을 순매도한 것도 부담으로 작용하며 약세로 돌아섬.

IRS 금리, 소폭 상승.

단기 쪽(특히 1.5년)에서 오퍼 수요가 많아 금리 상승 폭이 제한됨.

CRS 금리, 소폭 하락.