IPS Daily Morning Brief

2018-05-15

종가 기준일 2018-05-14

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7400	-0.50	1.7465	1.7393	1.7243	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.8250	-0.25	1.8260	1.8038	1.7873	1.8275	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.9050	0.50	1.8975	1.8676	1.8479	1.9050	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	2.0225	1.25	2.0130	1.9700	1.9526	2.0225	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.1075	2.00	2.0900	2.0456	2.0312	2.1075	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.2125	2.75	2.1920	2.1446	2.1345	2.2175	1.5050	2.9275	1.1550
4Y	2.2775	2.50	2.2595	2.2120	2.2010	2.2950	1.5625	3.0550	1.1575
5Y	2.3175	2.00	2.3040	2.2576	2.2464	2.3400	1.6125	3.1675	1.1575
7Y	2.3625	1.75	2.3510	2.3049	2.2967	2.3950	1.6825	3.3125	1.1675
10Y	2.4250	1.00	2.4170	2.3731	2.3684	2.4850	1.7725	3.4600	1.2125
12Y	2.4650	1.00	2.4585	2.4173	2.4120	2.5225	1.8000	3.5000	1.2150
15Y	2.4850	1.00	2.4785	2.4373	2.4315	2.5400	1.7900	3.5175	1.2150
20Y	2.5075	1.00	2.5010	2.4598	2.4525	2.5600	1.7000	3.6675	1.2150

6*9M	8.50	0.25	7.95	6.45	6.30	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	8.00	0.75	7.15	6.39	6.06	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	20.25	1.50	19.25	17.80	18.33	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.50	0.75	10.20	9.90	10.33	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	17.00	0.50	16.95	16.64	16.98	21.75	8.50	26.50	-1.75
2*5Y	21.00	0.00	21.40	21.20	21.52	27.25	11.75	37.75	-1.75
3*4Y	6.50	-0.25	6.75	6.74	6.65	8.50	3.25	13.25	-0.50
3*5Y	10.50	-0.75	11.20	11.30	11.19	14.00	6.00	24.50	-0.50
4*5Y	4.00	-0.50	4.45	4.56	4.54	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.50	-0.25	4.70	4.72	5.03	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	10.75	-1.00	11.30	11.55	12.20	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	-0.75	6.60	6.83	7.17	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.15	4.41	4.36	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.00	0.00	6.15	6.41	6.32	6.50	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.25	0.00	8.40	8.66	8.41	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.914	1.10	1.899	1.860	1.879	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.113	1.50	2.093	2.035	2.040	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.212	2.20	2.200	2.152	2.156	2.230	1.560	2.830	1.225
3Y	2.305	2.30	2.293	2.240	2.242	2.315	1.600	2.920	1.200
4Y	2.478	2.20	2.465	2.418	2.413	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.582	2.20	2.569	2.507	2.488	2.602	1.770	3.283	1.217
7Y	2.694	1.30	2.687	2.632	2.617	2.728	1.965	3.487	1.270
10Y	2.792	0.70	2.786	2.730	2.706	2.812	2.047	3.680	1.355
20Y	2.772	1.00	2.768	2.732	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	107.47	-0.05	107.51	107.53	107.44
LKTB	119.03	-0.04	118.99	119.13	118.94

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	-0.90	-0.60	-0.15	0.77	-3.07	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-9.05	-0.25	-7.98	-6.47	-8.77	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.45	-0.20	-10.96	-10.60	-12.47	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-9.25	0.45	-10.08	-9.50	-10.80	4.75	-14.95	5.00	-19.50
4Y	-20.05	0.30	-20.59	-20.60	-21.16	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-26.45	-0.20	-26.54	-24.97	-24.21	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.15	0.45	-33.56	-32.68	-32.00	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-36.70	0.30	-36.90	-35.65	-33.72	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.45	0.00	-26.74	-27.27	-25.53	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-76.50	4.50
-84.75	3.25
-90.25	3.00
-94.25	2.25
-95.25	3.00
-93.75	3.50
-82.25	3.75
-65.00	4.50

CRS

USD/KRW 1068.00 (-1.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1400	5.00	1.6200	0.7650	1*2Y	6.50	0.00
1.5Y	1.1750	4.50	1.6600	0.8100	2*3Y	6.50	0.00
2Y	1.2050	5.00	1.6950	0.8650	2*5Y	17.50	0.50
3Y	1.2700	5.00	1.7550	0.9550	3*4Y	5.50	0.50
4Y	1.3250	5.50	1.8000	1.0150	3*5Y	11.00	0.50
5Y	1.3800	5.50	1.8500	1.0350	4*5Y	5.50	0.00
7Y	1.5400	5.50	1.8950	1.0400	5*7Y	16.00	0.00
10Y	1.7750	5.50	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	2.5516	0.0126	2.5390	2.5261	2.5341	2.5516	1.1360	2.5516	0.3000
10Y	3.0024	0.0329	2.9695	2.9649	3.0056	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	33.96	-0.94	34.90	34.41	32.91	38.23	-54.10	38.23	-251.80
10Y	21.04	2.59	18.45	18.79	20.56	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	31.75	-1.00	32.75	32.75	33.50	42.50	19.50	66.75	2.75
KTB 2*10Y	58.00	-1.50	59.50	59.50	59.50	68.70	35.80	88.80	11.80
UST 2*10Y	45.08	2.03	43.05	43.88	47.15	135.50	41.06	256.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	74 / 74.25	ODD Tenor	
09M			
01Y	90.5		
1.5Y	2.25		
02Y	9	SPRD	6m*1.5y 28.25
03Y	21.25		10*12y 04
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	61 건	-22	83	96	77	111	141	141
금 액	27,565 억원	-2,583	30,148	28,403	36,688	47,180	40,291	40,291

장중동향

국고채 금리 상승.

금통위 경계와 외인의 3년국채선물 매도로 약세 마감. 단기물이 상대적으로 약세를 보이며 커브 플랫 마감.

IRS는 국채선물에 연동해 움직였고, 금통위 경계감으로 거래보다는 눈치보기 장세.

CRS도 전구간 상승 마감. 부채소식에 상승압박을 보인것으로 보임.