

IPS Daily Morning Brief

2018-05-24

종가 기준일 2018-05-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7275	0.25	1.7225	1.7366	1.7265	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7950	0.25	1.7915	1.8066	1.7901	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8575	0.00	1.8585	1.8741	1.8517	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9625	-0.75	1.9675	1.9823	1.9560	2.0250	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.0450	-1.50	2.0555	2.0626	2.0339	2.1150	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.1475	-2.00	2.1615	2.1656	2.1354	2.2225	1.5050	2.9275	1.1550
4Y	2.2150	-2.00	2.2305	2.2354	2.2008	2.2950	1.5625	3.0475	1.1575
5Y	2.2600	-2.00	2.2750	2.2813	2.2448	2.3400	1.6125	3.1600	1.1575
7Y	2.3175	-2.00	2.3330	2.3324	2.2942	2.3950	1.6825	3.3125	1.1675
10Y	2.3925	-2.00	2.4090	2.4014	2.3638	2.4850	1.7725	3.4600	1.2125
12Y	2.4325	-2.00	2.4490	2.4438	2.4075	2.5225	1.8000	3.4950	1.2150
15Y	2.4575	-2.00	2.4730	2.4649	2.4277	2.5400	1.7900	3.5175	1.2150
20Y	2.4925	-2.00	2.5060	2.4901	2.4498	2.5600	1.7000	3.6675	1.2150

6*9M	6.75	0.00	6.90	7.00	6.36	12.50	-1.50	12.50	-6.00
9*12M	6.25	-0.25	6.70	6.75	6.16	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	18.75	-1.50	19.70	18.85	18.23	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.25	-0.50	10.60	10.30	10.15	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	17.00	-0.50	17.50	17.28	16.69	21.75	8.50	24.75	-1.75
2*5Y	21.50	-0.50	21.95	21.86	21.09	27.25	11.75	36.00	-1.75
3*4Y	6.75	0.00	6.90	6.97	6.54	8.50	3.25	12.00	-0.50
3*5Y	11.25	0.00	11.35	11.56	10.94	14.00	6.00	23.25	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.45	4.59	4.40	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	5.75	0.00	5.80	5.11	4.94	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	13.25	0.00	13.40	12.01	11.90	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.50	0.00	7.60	6.90	6.96	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.24	4.37	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.40	6.35	6.40	6.50	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	10.00	0.00	9.70	8.88	8.61	10.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.859	1.00	1.851	1.865	1.878	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.024	-1.00	2.030	2.049	2.040	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.137	-2.00	2.147	2.164	2.153	2.230	1.560	2.830	1.225
3Y	2.225	-2.40	2.242	2.257	2.239	2.315	1.600	2.920	1.200
4Y	2.402	-2.20	2.419	2.435	2.413	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.505	-2.20	2.523	2.535	2.488	2.602	1.770	3.283	1.217
7Y	2.632	-2.40	2.653	2.658	2.614	2.728	1.965	3.487	1.270
10Y	2.740	-2.50	2.763	2.761	2.705	2.815	2.047	3.680	1.355
20Y	2.750	-2.00	2.767	2.757	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	107.75	0.07	107.68	107.75	107.66
LKTB	119.58	0.25	119.36	119.58	119.26

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	-0.15	-1.00	0.71	0.96	-2.64	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-6.15	0.25	-6.21	-6.67	-8.36	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-9.20	0.50	-9.15	-10.18	-11.90	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-7.75	0.40	-8.01	-9.15	-10.40	4.75	-14.20	5.00	-19.50
4Y	-18.70	0.20	-18.89	-19.92	-21.26	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-24.50	0.20	-24.76	-25.34	-24.35	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.45	0.40	-31.98	-32.60	-32.03	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-34.75	0.50	-35.44	-35.96	-34.17	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-25.75	0.00	-26.14	-26.70	-25.86	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1080.70 (-4.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-77.25	-2.50	1Y	1.0850	-2.50	1.6200	0.7650	1*2Y	4.50	2.50	
-85.75	-0.75	1.5Y	1.1050	-1.50	1.6600	0.8100	2*3Y	3.00	0.50	
-91.50	1.50	2Y	1.1300	0.00	1.6950	0.8650	2*5Y	11.50	-1.00	
-98.75	2.50	3Y	1.1600	0.50	1.7550	0.9550	3*4Y	4.00	-0.50	
-101.50	2.00	4Y	1.2000	0.00	1.8000	1.0150	3*5Y	8.50	-1.50	
-101.50	1.00	5Y	1.2450	-1.00	1.8500	1.0350	4*5Y	4.50	-1.00	
-90.75	1.00	7Y	1.4100	-1.00	1.8950	1.0400	5*7Y	16.50	0.00	
-72.75	1.50	10Y	1.6650	-0.50	2.0500	1.0500	5*10Y	42.00	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	2.5361	-0.0339	2.5700	2.5740	2.5446	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.9935	-0.0699	3.0634	3.0587	3.0587	3.1131	2.0387	3.1131	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	39.91	-1.39	41.30	41.70	42.26	42.26	-53.43	42.26	-251.80
10Y	25.35	-4.49	29.84	29.37	30.87	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	34.75	-0.50	35.25	35.25	35.75	42.50	19.50	66.00	2.75
KTb 2*10Y	60.30	-0.50	60.80	60.80	62.80	68.70	35.80	85.00	11.80
UST 2*10Y	45.74	-3.60	49.34	48.47	51.41	135.50	41.06	246.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	79.25								
01Y	85.75								
1.5Y									
02Y	4.75 / 05	SPRD							
03Y	14.75 / 15.75 / 17								
04Y	22.5								
05Y	27								
07Y	31.75 / 32.75								
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	74 건	6	68	68	169	141	102	86	
금 액	27,050 억원	4,690	22,360	22,360	53,537	0,010	34,548	31,626	

장중동향
 금통위 경계감, 대기매수 유입으로 채권 금리 하락. 시장은 소수의견에따라 변동성을 다르게 예측하면서도 쉽게 밀리지 않을것으로 판단 강세. 커브는 소폭 플랫마감.

IRS는 금통위 경계감속에 조용하다가 오전에는 2년, 3년 정도로 간간히 거래. 1년 아래 단기는 비드, 1년부터 5년정도까지는 오퍼, 그 뒤쪽으로는 비드가 우위. 오후들어 거래량이 늘어났고, 국채선물 중가가 오르면서 후반 오퍼가 많이나와 레벨 하락 마감.

CRS는 혼조세.