

IPS Daily Morning Brief

2018-05-25

종가 기준일 2018-05-24

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7025	-2.50	1.7185	1.7351	1.7263	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7750	-2.00	1.7865	1.8056	1.7900	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8375	-2.00	1.8505	1.8729	1.8516	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9400	-2.25	1.9575	1.9814	1.9560	2.0250	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.0175	-2.75	2.0435	2.0618	2.0336	2.1150	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.1175	-3.00	2.1485	2.1644	2.1348	2.2225	1.5050	2.9275	1.1550
4Y	2.1850	-3.00	2.2160	2.2338	2.2002	2.2950	1.5625	3.0475	1.1575
5Y	2.2300	-3.00	2.2610	2.2794	2.2440	2.3400	1.6125	3.1600	1.1575
7Y	2.2925	-2.50	2.3200	2.3311	2.2935	2.3950	1.6825	3.3125	1.1675
10Y	2.3700	-2.25	2.3960	2.4005	2.3628	2.4850	1.7725	3.4600	1.2125
12Y	2.4100	-2.25	2.4360	2.4426	2.4065	2.5225	1.8000	3.4950	1.2150
15Y	2.4350	-2.25	2.4605	2.4640	2.4269	2.5400	1.7900	3.5175	1.2150
20Y	2.4700	-2.25	2.4955	2.4899	2.4493	2.5600	1.7000	3.6675	1.2150

6*9M	7.25	0.50	6.80	7.05	6.37	12.50	-1.50	12.50	-6.00
9*12M	6.25	0.00	6.40	6.73	6.16	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	18.00	-0.75	19.30	18.89	18.20	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.00	-0.25	10.50	10.26	10.12	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	16.75	-0.25	17.25	17.20	16.65	21.75	8.50	24.75	-1.75
2*5Y	21.25	-0.25	21.75	21.76	21.04	27.25	11.75	36.00	-1.75
3*4Y	6.75	0.00	6.75	6.94	6.53	8.50	3.25	12.00	-0.50
3*5Y	11.25	0.00	11.25	11.50	10.92	14.00	6.00	23.25	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.50	4.56	4.39	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	6.25	0.50	5.90	5.18	4.94	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	14.00	0.75	13.50	12.11	11.88	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.75	0.25	7.60	6.94	6.94	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.21	4.37	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.45	6.35	6.41	6.50	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	10.00	0.00	9.95	8.94	8.65	10.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.844	-1.50	1.847	1.864	1.878	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.995	-2.90	2.019	2.048	2.039	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.107	-3.00	2.136	2.163	2.152	2.230	1.560	2.830	1.225
3Y	2.190	-3.50	2.227	2.256	2.238	2.315	1.600	2.920	1.200
4Y	2.375	-2.70	2.405	2.433	2.413	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.480	-2.50	2.508	2.534	2.488	2.602	1.770	3.283	1.217
7Y	2.610	-2.20	2.638	2.657	2.614	2.728	1.965	3.487	1.270
10Y	2.720	-2.00	2.748	2.760	2.705	2.815	2.047	3.680	1.355
20Y	2.732	-1.80	2.756	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	107.85	0.10	107.80	107.93	107.80
LKTB	119.78	0.20	119.81	120.18	119.78

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	-0.65	-0.50	0.33	0.90	-2.63	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-5.50	0.65	-6.17	-6.64	-8.30	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-8.95	0.25	-9.25	-10.13	-11.82	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-7.25	0.50	-7.81	-9.12	-10.33	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-19.00	-0.30	-18.88	-19.91	-21.27	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-25.00	-0.50	-24.72	-25.43	-24.36	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.75	-0.30	-31.80	-32.60	-32.02	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-35.00	-0.25	-35.20	-35.95	-34.24	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.20	-0.45	-26.09	-26.68	-25.90	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW	1079.60 (-1.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-79.25	-2.00	1Y	1.0450	-4.00	1.6200	0.7650	1*2Y	7.50	3.00
-86.00	-0.25	1.5Y	1.0800	-2.50	1.6600	0.8100	2*3Y	2.50	-0.50
-89.75	1.75	2Y	1.1200	-1.00	1.6950	0.8650	2*5Y	10.00	-1.50
-97.25	1.50	3Y	1.1450	-1.50	1.7550	0.9550	3*4Y	3.50	-0.50
-100.50	1.00	4Y	1.1800	-2.00	1.8000	1.0150	3*5Y	7.50	-1.00
-101.00	0.50	5Y	1.2200	-2.50	1.8500	1.0350	4*5Y	4.00	-0.50
-90.75	0.00	7Y	1.3850	-2.50	1.8950	1.0400	5*7Y	16.50	0.00
-73.00	-0.25	10Y	1.6400	-2.50	2.0500	1.0500	5*10Y	42.00	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	2.5201	-0.0160	2.5361	2.5700	2.5740	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.9770	-0.0165	2.9935	3.0634	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	41.31	1.4	39.91	41.30	41.70	42.26	-53.43	42.26	-251.80
10Y	25.70	0.35	25.35	29.84	29.37	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	35.25	0.50	34.75	35.25	35.25	42.50	19.50	66.00	2.75
KTb 2*10Y	61.30	1.00	60.30	60.80	60.80	68.70	35.80	85.00	11.80
UST 2*10Y	45.69	-0.05	45.74	49.34	48.47	135.50	41.06	246.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M	70								
09M									
01Y	82.75								
1.5Y	94.5								
02Y									
03Y	10								
04Y									
05Y									
07Y									
10Y	34.5 / 36								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	133 건	59	74	68	68	169	141	102	
금 액	51,770 억원	24,720	27,050	22,360	22,360	53,537	0,010	34,548	

장중동향

국고채 금리, 한은 기준금리 만장일치 동결에 강세폭 키우며 금리 하락 마감.
이주열 한은 총재의 기자간담회 언급도 비둘기파 스탠스에 다소 기울었다는 분위기.
바이백이 이달부터 시행될 가능성이 크다는 소식도 강세 압력.

IRS, 금리 하락 마감. 기준금리 만장일치 동결되면서 뚜렷한 강세.
8/31 금통위 이전 폭락이 되는 단기 구간으로 오퍼가 집중되며 금리 하락.
향후 3개월간 시간을 벌었다는 인식에 증권사들은 헤지 물량을 되돌리는 분위기.
CRS, 전 구간 금리 하락.