IPS Daily Morning Brief

2018-05-28

종가 기준일 2018-05-25

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7100	0.75	1.7180	1.7343	1.7258	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7825	0.75	1.7875	1.8053	1.7895	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8450	0.75	1.8510	1.8726	1.8511	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9450	0.50	1.9575	1.9814	1.9554	2.0250	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.0250	0.75	2.0415	2.0621	2.0328	2.1150	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.1300	1.25	2.1460	2.1651	2.1339	2.2225	1.5050	2.9275	1.1550
4Y	2.1975	1.25	2.2135	2.2344	2.1992	2.2950	1.5625	3.0475	1.1575
5Y	2.2400	1.00	2.2580	2.2800	2.2430	2.3400	1.6125	3.1600	1.1575
7Y	2.2975	0.50	2.3165	2.3321	2.2925	2.3950	1.6825	3.3125	1.1675
10Y	2.3750	0.50	2.3925	2.4020	2.3619	2.4850	1.7725	3.4600	1.2125
12Y	2.4150	0.50	2.4325	2.4439	2.4056	2.5225	1.8000	3.4950	1.2150
15Y	2.4400	0.50	2.4575	2.4655	2.4261	2.5400	1.7900	3.5175	1.2150
20Y	2.4700	0.00	2.4915	2.4918	2.4486	2.5600	1.7000	3.6675	1.2150

6*9M	7.25	0.00	6.95	7.10	6.37	12.50	-1.00	12.50	-6.00
9*12M	6.25	0.00	6.35	6.74	6.16	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	18.00	0.00	19.05	18.95	18.17	23.00	1.00	23.00	-5.50
2*3Y	10.50	0.50	10.45	10.30	10.10	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	17.25	0.50	17.20	17.23	16.64	21.75	8.75	24.75	-1.75
2*5Y	21.50	0.25	21.65	21.79	21.02	27.25	11.75	36.00	-1.75
3*4Y	6.75	0.00	6.75	6.92	6.53	8.50	3.25	12.00	-0.50
3*5Y	11.00	-0.25	11.20	11.49	10.92	14.00	6.00	23.25	-0.50
4*5Y	4.25	-0.25	4.45	4.56	4.38	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	5.75	-0.50	5.85	5.21	4.95	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	13.50	-0.50	13.45	12.20	11.88	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.75	0.00	7.60	6.99	6.93	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.19	4.37	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.35	6.42	6.50	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.50	-0.50	9.90	8.98	8.68	10.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.849	0.50	1.850	1.864	1.878	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.998	0.30	2.017	2.047	2.038	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.115	0.80	2.135	2.163	2.150	2.230	1.560	2.830	1.225
3Y	2.202	1.20	2.223	2.256	2.236	2.315	1.600	2.920	1.200
4Y	2.385	1.00	2.402	2.433	2.412	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.485	0.50	2.505	2.535	2.487	2.602	1.770	3.283	1.217
7Y	2.613	0.30	2.633	2.658	2.613	2.728	1.965	3.487	1.270
10Y	2.720	0.00	2.742	2.761	2.705	2.815	2.047	3.680	1.355
20Y	2.722	-1.00	2.749	2.758	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	107.83	-0.02	107.89	107.92	107.83
LKTB	119.75	-0.03	119.85	119.97	119.75

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	-0.40	0.25	0.10	0.85	-2.64	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-5.30	0.20	-5.95	-6.59	-8.26	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-9.00	-0.05	-9.31	-10.08	-11.74	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-7.20	0.05	-7.70	-9.05	-10.26	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-18.75	0.25	-18.85	-19.87	-21.27	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-24.50	0.50	-24.68	-25.46	-24.35	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.55	0.20	-31.69	-32.59	-32.00	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-34.50	0.50	-34.95	-35.92	-34.28	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-25.20	1.00	-25.73	-26.62	-25.90	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-75.00	4.25
-81.50	4.50
-85.50	4.25
-93.50	3.75
-97.25	3.25
-98.00	3.00
-88.25	2.50
-70.50	2.50

CRS

USD/KRW 1078.00 (-1.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.0950	5.00	1.6200	0.7650	1*2Y	7.50	0.00
1.5Y	1.1300	5.00	1.6600	0.8100	2*3Y	2.50	0.00
2Y	1.1700	5.00	1.6950	0.8650	2*5Y	9.00	-1.00
3Y	1.1950	5.00	1.7550	0.9550	3*4Y	3.00	-0.50
4Y	1.2250	4.50	1.8000	1.0150	3*5Y	6.50	-1.00
5Y	1.2600	4.00	1.8500	1.0350	4*5Y	3.50	-0.50
7Y	1.4150	3.00	1.8950	1.0400	5*7Y	15.50	-1.00
10Y	1.6700	3.00	2.0500	1.0500	5*10Y	41.00	-1.00

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	2.4840	-0.0361	2.5201	2.5361	2.5700	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.9286	-0.0484	2.9770	2.9935	3.0634	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	36.90	-4.41	41.31	39.91	41.30	42.26	-53.43	42.26	-251.80
10Y	20.86	-4.84	25.70	25.35	29.84	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	35.00	-0.25	35.25	34.75	35.25	42.50	19.50	66.00	2.75
KTB 2*10Y	60.50	-0.80	61.30	60.30	60.80	68.70	35.80	85.00	11.80
UST 2*10Y	44.46	-1.23	45.69	45.74	49.34	135.50	41.06	246.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	83.5		
1.5Y	93.25		
02Y		SPRD	3*5Y 11.25 / 11.5
03Y	10.25 / 10.75 / 11.5		6*9m 7.25
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	37.5		
12Y			
15Y			
20Y	47		
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	76 건	-57	133	74	68	68	169	141
금 액	24,820 억원	-26,950	51,770	27,050	22,360	22,360	53,537	0,010

장중동향

국고채 금리, 단기금리는 상승 장기금리는 하락.
국채선물은 금통위 이벤트 해소와 북미정상회담 취소로 인한 글로벌 안전자산 선호 심리에 강세로 출발. 제롬 파월 Fed의장의 연설을 앞둔 가운데 다음 주 경제지표 발표가 있어 강세는 장 후반으로 갈수록 점차 누그러짐.

IRS 금리, 상승.
북미 회담 결렬에도 시장은 전반적으로 조용한 분위기. 다만 장 후반 외국인이 3년 국채선물을 대거 매도함에 따라 IRS 금리도 따라 상승.