

IPS Daily Morning Brief

2018-05-29

종가 기준일 2018-05-28

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7050	-0.50	1.7140	1.7331	1.7253	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7775	-0.50	1.7845	1.8046	1.7890	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8400	-0.50	1.8475	1.8721	1.8505	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9400	-0.50	1.9515	1.9811	1.9547	2.0250	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.0225	-0.25	2.0340	2.0624	2.0320	2.1150	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.1225	-0.75	2.1370	2.1655	2.1330	2.2225	1.5050	2.9250	1.1550
4Y	2.1925	-0.50	2.2050	2.2348	2.1985	2.2950	1.5625	3.0300	1.1575
5Y	2.2400	0.00	2.2500	2.2806	2.2425	2.3400	1.6125	3.1400	1.1575
7Y	2.2975	0.00	2.3085	2.3331	2.2920	2.3950	1.6825	3.2925	1.1675
10Y	2.3700	-0.50	2.3840	2.4033	2.3613	2.4850	1.7725	3.4375	1.2125
12Y	2.4100	-0.50	2.4240	2.4449	2.4050	2.5225	1.8000	3.4725	1.2150
15Y	2.4350	-0.50	2.4490	2.4668	2.4256	2.5400	1.7900	3.4975	1.2150
20Y	2.4650	-0.50	2.4820	2.4934	2.4483	2.5600	1.7000	3.6450	1.2150

6*9M	7.25	0.00	7.05	7.15	6.36	12.50	-1.00	12.50	-6.00
9*12M	6.25	0.00	6.30	6.75	6.16	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	18.25	0.25	18.65	19.03	18.15	23.00	1.00	23.00	-5.50
2*3Y	10.00	-0.50	10.30	10.31	10.10	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	17.00	-0.25	17.10	17.24	16.64	21.75	8.75	24.00	-1.75
2*5Y	21.75	0.25	21.60	21.83	21.04	27.25	11.75	35.00	-1.75
3*4Y	7.00	0.25	6.80	6.92	6.55	8.50	3.25	11.75	-0.50
3*5Y	11.75	0.75	11.30	11.51	10.95	14.00	6.00	22.75	-0.50
4*5Y	4.75	0.50	4.50	4.59	4.40	6.25	2.25	11.00	-0.25
5*7Y	5.75	0.00	5.85	5.25	4.95	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	13.00	-0.50	13.40	12.26	11.88	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.25	-0.50	7.55	7.01	6.93	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.16	4.37	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.35	6.43	6.50	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.50	0.00	9.80	9.01	8.70	10.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.866	1.70	1.853	1.865	1.877	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.999	0.10	2.010	2.047	2.037	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.115	0.00	2.126	2.163	2.149	2.230	1.560	2.818	1.225
3Y	2.202	0.00	2.214	2.256	2.235	2.315	1.600	2.913	1.200
4Y	2.385	0.00	2.394	2.433	2.411	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.495	1.00	2.498	2.536	2.486	2.602	1.770	3.260	1.217
7Y	2.618	0.50	2.626	2.659	2.612	2.728	1.965	3.461	1.270
10Y	2.722	0.20	2.733	2.763	2.705	2.815	2.047	3.655	1.355
20Y	2.722	0.00	2.739	2.759	2.708	2.792	2.110	3.883	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	0.02	107.88	107.89	107.81
LKTb	119.75	0.00	120.01	120.06	119.70

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	-2.60	-2.20	-0.59	0.70	-2.66	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-5.90	-0.60	-5.85	-6.57	-8.21	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-9.25	-0.25	-9.22	-10.04	-11.67	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-7.95	-0.75	-7.66	-9.03	-10.18	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-19.25	-0.50	-18.92	-19.86	-21.27	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-25.50	-1.00	-24.84	-25.53	-24.34	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.05	-0.50	-31.73	-32.61	-31.98	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-35.20	-0.70	-34.94	-35.93	-34.33	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-25.70	-0.50	-25.72	-26.58	-25.92	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1074.20 (-3.80)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-76.50	-1.50	1Y	1.0750	-2.00	1.6200	0.7650	1*2Y	8.00	0.50
-83.00	-1.50	1.5Y	1.1100	-2.00	1.6600	0.8100	2*3Y	2.00	-0.50
-86.75	-1.25	2Y	1.1550	-1.50	1.6950	0.8650	2*5Y	8.50	-0.50
-94.75	-1.25	3Y	1.1750	-2.00	1.7550	0.9550	3*4Y	3.00	0.00
-98.75	-1.50	4Y	1.2050	-2.00	1.8000	1.0150	3*5Y	6.50	0.00
-100.00	-2.00	5Y	1.2400	-2.00	1.8500	1.0350	4*5Y	3.50	0.00
-91.25	-3.00	7Y	1.3850	-3.00	1.8950	1.0400	5*7Y	14.50	-1.00
-73.00	-2.50	10Y	1.6400	-3.00	2.0500	1.0500	5*10Y	40.00	-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	0.0000	2.4840	2.5201	2.5361	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.9286	0.0000	2.9286	2.9770	2.9935	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	0	36.90	41.31	39.91	42.26	-53.43	42.26	-251.80
10Y	20.66	-0.20	20.86	25.70	25.35	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	-0.25	35.00	35.25	34.75	42.50	19.50	64.75	2.75
KTb 2*10Y	60.70	0.20	60.50	61.30	60.30	68.70	35.80	84.00	11.80
UST 2*10Y	44.46	0.00	44.46	45.69	45.74	133.70	41.06	246.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6y 26						
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	93.75								
02Y	1								
03Y	11.25 / 12.25 / 12.5								
04Y									
05Y	23.75								
07Y									
10Y		SPRD							
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y 8.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	77 건	1	76	133	74	68	68	169	
금 액	27,843 억원	3,023	24,820	51,770	27,050	22,360	22,360	53,537	

장중동향
채권 금리 약보합. 소폭상승. 지표부진과 유가하락, 이탈리아 불안 등으로 인한 미국채 금리하락에도 불구하고 지난주 강세에 대한 차익거래로 소폭 약세전환. 외국인인 매수가 계속 되고있지만 뚜렷한 강세는 보이지 않음. 큰 방향성 없이 거래가 부진한 장.

IRS는 장 시작부터 오퍼가 우위를 보이며 레벨 하락. 중단기 구간에서는 3년, 장기구간에서는 10년으로 오퍼가 많이 등장. 커브는 2*3y, 5*10y 구간이 소폭 플랫마감.

CRS 전테너 하락마감.