

IPS Daily Morning Brief

2018-05-30

종가 기준일 2018-05-29

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6900	-1.50	1.7070	1.7311	1.7245	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7650	-1.25	1.7790	1.8033	1.7883	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8250	-1.50	1.8410	1.8706	1.8498	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9225	-1.75	1.9420	1.9796	1.9537	2.0250	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.0000	-2.25	2.0220	2.0610	2.0310	2.1150	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.0950	-2.75	2.1225	2.1639	2.1318	2.2225	1.5050	2.9250	1.1550
4Y	2.1625	-3.00	2.1905	2.2330	2.1973	2.2950	1.5625	3.0150	1.1575
5Y	2.2125	-2.75	2.2365	2.2791	2.2414	2.3400	1.6125	3.0950	1.1575
7Y	2.2650	-3.25	2.2940	2.3318	2.2910	2.3950	1.6825	3.2350	1.1675
10Y	2.3325	-3.75	2.3680	2.4019	2.3601	2.4850	1.7725	3.3775	1.2125
12Y	2.3725	-3.75	2.4080	2.4433	2.4038	2.5225	1.8000	3.4125	1.2150
15Y	2.3975	-3.75	2.4330	2.4654	2.4245	2.5400	1.7900	3.4375	1.2150
20Y	2.4275	-3.75	2.4650	2.4924	2.4473	2.5600	1.7000	3.5725	1.2150

6*9M	7.50	0.25	7.20	7.21	6.38	12.50	-1.00	12.50	-6.00
9*12M	6.00	-0.25	6.20	6.74	6.15	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	17.50	-0.75	18.10	19.04	18.12	23.00	1.00	23.00	-5.50
2*3Y	9.50	-0.50	10.05	10.29	10.08	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	16.25	-0.75	16.85	17.20	16.63	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	21.25	-0.50	21.45	21.81	21.05	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	6.75	-0.25	6.80	6.91	6.55	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	11.75	0.00	11.40	11.53	10.97	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	5.00	0.25	4.60	4.61	4.42	6.25	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	5.25	-0.50	5.75	5.26	4.95	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	12.00	-1.00	13.15	12.28	11.87	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	-0.50	7.40	7.01	6.91	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.14	4.37	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.35	6.44	6.50	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.50	0.00	9.70	9.05	8.73	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	-0.70	1.855	1.866	1.876	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.987	-1.20	2.001	2.046	2.035	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.105	-1.00	2.116	2.162	2.147	2.230	1.560	2.818	1.225
3Y	2.187	-1.50	2.201	2.254	2.233	2.315	1.600	2.913	1.200
4Y	2.369	-1.60	2.383	2.432	2.410	2.502	1.722	3.165	1.232
5Y	2.480	-1.50	2.489	2.535	2.485	2.602	1.770	3.230	1.217
7Y	2.590	-2.80	2.613	2.658	2.610	2.728	1.965	3.418	1.270
10Y	2.687	-3.50	2.718	2.761	2.704	2.815	2.047	3.615	1.355
20Y	2.707	-1.50	2.727	2.758	2.707	2.792	2.110	3.840	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.45	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.90	0.05	107.89	107.90	107.86
LKTb	120.15	0.40	119.93	120.15	119.87

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	-3.40	-0.80	-1.44	0.42	-2.67	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-6.45	-0.55	-5.86	-6.63	-8.15	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.50	-1.25	-9.38	-10.08	-11.59	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-9.20	-1.25	-7.87	-9.04	-10.11	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-20.65	-1.40	-19.27	-19.90	-21.27	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-26.75	-1.25	-25.25	-25.63	-24.33	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.50	-0.45	-31.86	-32.61	-31.94	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-35.45	-0.25	-34.98	-35.92	-34.34	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-27.95	-2.25	-26.16	-26.61	-25.93	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1076.80 (+2.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-79.50	-3.00	1Y	1.0300	-4.50	1.6200	0.7650	1*2Y	9.50	1.50	
-84.75	-1.75	1.5Y	1.0750	-3.50	1.6600	0.8100	2*3Y	2.50	0.50	
-87.50	-0.75	2Y	1.1250	-3.00	1.6950	0.8650	2*5Y	9.00	0.50	
-94.50	0.25	3Y	1.1500	-2.50	1.7550	0.9550	3*4Y	3.00	0.00	
-98.25	0.50	4Y	1.1800	-2.50	1.8000	1.0150	3*5Y	6.50	0.00	
-99.75	0.25	5Y	1.2150	-2.50	1.8500	1.0350	4*5Y	3.50	0.00	
-91.00	0.25	7Y	1.3550	-3.00	1.8950	1.0400	5*7Y	14.00	-0.50	
-72.25	0.75	10Y	1.6100	-3.00	2.0500	1.0500	5*10Y	39.50	-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	2.3274	-0.1566	2.4840	2.4840	2.5201	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.7765	-0.1521	2.9286	2.9286	2.9770	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	22.24	-14.66	36.90	36.90	41.31	42.26	-53.43	42.26	-251.80
10Y	8.95	-11.71	20.66	20.86	25.70	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	33.25	-1.50	34.75	35.00	35.25	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	58.20	-2.50	60.70	60.50	61.30	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	44.91	0.45	44.46	44.46	45.69	133.70	41.06	243.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M						76.75			
01Y									
1.5Y									
02Y						0.5			
03Y						11.25 / 11.5			
04Y									
05Y						21.25 / 21.5 / 22 / 22.25 / 22.5			
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	101 건	24	77	76	133	74	68	68	
금 액	50,708 억원	22,865	27,843	24,820	51,770	27,050	22,360	22,360	

장중동향
 국고채 금리, 유럽시장 개장 직후 이탈리아 국채 금리 폭등으로 국내까지 안전자산 분위기 조성되며 국고채 금리 하락.
 IRS, 유럽발 안전자산 선호 분위기에 금리 하락. 커브 플랫트닝.
 장중 내내 오피 우위.

CRS, 유럽발 신용리스크에 FX스왑포인트가 크게 놀리자 영향을 받으며 금리 하락 마감.