

IPS Daily Morning Brief

2018-05-31

종가 기준일 2018-05-30

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6900	0.00	1.6995	1.7289	1.7238	1.7550	1.3900	2.6625	1.2875
9M	1.7650	0.00	1.7730	1.8018	1.7876	1.8300	1.4100	2.6825	1.2500
1Y	1.8275	0.25	1.8350	1.8693	1.8491	1.9100	1.4350	2.7100	1.2200
1.5Y	1.9250	0.25	1.9345	1.9780	1.9528	2.0250	1.4625	2.7700	1.1900
2Y	2.0025	0.25	2.0135	2.0594	2.0300	2.1150	1.4700	2.8275	1.1675
3Y	2.1000	0.50	2.1130	2.1620	2.1307	2.2225	1.5050	2.9250	1.1550
4Y	2.1675	0.50	2.1810	2.2308	2.1964	2.2950	1.5625	3.0150	1.1575
5Y	2.2175	0.50	2.2280	2.2769	2.2407	2.3400	1.6125	3.0950	1.1575
7Y	2.2700	0.50	2.2845	2.3295	2.2903	2.3950	1.6825	3.2350	1.1675
10Y	2.3375	0.50	2.3570	2.3995	2.3594	2.4850	1.7725	3.3775	1.2125
12Y	2.3775	0.50	2.3970	2.4406	2.4030	2.5225	1.8000	3.4125	1.2150
15Y	2.4050	0.75	2.4225	2.4631	2.4238	2.5400	1.7900	3.4375	1.2150
20Y	2.4350	0.75	2.4535	2.4905	2.4469	2.5600	1.7000	3.5725	1.2150

6*9M	7.50	0.00	7.35	7.29	6.39	12.50	-1.00	12.50	-6.00
9*12M	6.25	0.25	6.20	6.75	6.15	10.50	-0.50	10.50	-4.25
1*2Y	17.50	0.00	17.85	19.01	18.09	23.00	1.00	23.00	-5.50
2*3Y	9.75	0.25	9.95	10.26	10.07	13.25	3.50	13.25	-1.75
2*4Y	16.50	0.25	16.75	17.14	16.64	21.75	8.75	23.50	-1.75
2*5Y	21.50	0.25	21.45	21.75	21.07	27.25	11.75	34.00	-1.75
3*4Y	6.75	0.00	6.80	6.88	6.57	8.50	3.25	11.25	-0.50
3*5Y	11.75	0.00	11.50	11.49	11.00	14.00	6.00	22.00	-0.50
4*5Y	5.00	0.00	4.70	4.61	4.43	6.25	2.25	10.75	-0.25
5*7Y	5.25	0.00	5.65	5.26	4.96	10.50	2.50	14.75	0.25
5*10Y	12.00	0.00	12.90	12.26	11.87	20.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	0.00	7.25	7.00	6.91	11.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.11	4.36	4.50	1.75	7.75	-0.25
10*15Y	6.75	0.25	6.55	6.36	6.45	6.75	1.75	15.00	-0.75
10*20Y	9.75	0.25	9.65	9.10	8.75	10.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.857	-0.20	1.855	1.868	1.875	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	1.984	-0.30	1.993	2.045	2.033	2.113	1.517	2.750	1.232
2Y	2.110	0.50	2.110	2.160	2.145	2.230	1.560	2.818	1.225
3Y	2.192	0.50	2.195	2.252	2.231	2.315	1.600	2.913	1.200
4Y	2.376	0.70	2.378	2.430	2.409	2.502	1.722	3.165	1.232
5Y	2.485	0.50	2.485	2.534	2.484	2.602	1.770	3.230	1.217
7Y	2.598	0.80	2.606	2.656	2.609	2.728	1.965	3.418	1.270
10Y	2.695	0.80	2.709	2.758	2.703	2.815	2.047	3.615	1.355
20Y	2.705	-0.20	2.718	2.756	2.706	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	107.87	-0.03	108.05	108.06	107.85
LKTb	120.04	-0.11	120.80	120.85	119.90

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	-2.95	0.45	-2.00	0.17	-2.63	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-5.90	0.55	-5.81	-6.66	-8.06	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-10.75	-0.25	-9.69	-10.08	-11.51	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-9.20	0.00	-8.16	-9.00	-10.04	4.75	-13.50	5.00	-19.50
4Y	-20.85	-0.20	-19.70	-19.92	-21.28	-8.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-26.75	0.00	-25.70	-25.70	-24.34	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.80	-0.30	-32.13	-32.60	-31.91	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-35.75	-0.30	-35.18	-35.90	-34.35	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-27.00	0.95	-26.41	-26.52	-25.92	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS			USD/KRW			1080.90 (+4.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-80.75	-1.25	1Y	1.0200	-1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	9.50	0.00
-86.00	-1.25	1.5Y	1.0650	-1.00	1.6600	0.8100	2*3Y	2.00	-0.50
-88.75	-1.25	2Y	1.1150	-1.00	1.6950	0.8650	2*5Y	9.50	0.50
-96.50	-2.00	3Y	1.1350	-1.50	1.7550	0.9550	3*4Y	3.50	0.50
-99.75	-1.50	4Y	1.1700	-1.00	1.8000	1.0150	3*5Y	7.50	1.00
-100.75	-1.00	5Y	1.2100	-0.50	1.8500	1.0350	4*5Y	4.00	0.50
-92.00	-1.00	7Y	1.3500	-0.50	1.8950	1.0400	5*7Y	14.00	0.00
-73.25	-1.00	10Y	1.6050	-0.50	2.0500	1.0500	5*10Y	39.50	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	2.4074	0.0800	2.3274	2.4840	2.4840	2.5892	1.1410	2.5892	0.3000
10Y	2.8568	0.0803	2.7765	2.9286	2.9286	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	29.74	7.5	22.24	36.90	36.90	42.26	-53.43	42.26	-251.80
10Y	16.18	7.23	8.95	20.66	20.86	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	33.50	0.25	33.25	34.75	35.00	42.50	19.50	62.75	2.75
KTb 2*10Y	58.50	0.30	58.20	60.70	60.50	68.70	35.80	82.90	11.80
UST 2*10Y	44.94	0.03	44.91	44.46	44.46	133.10	41.06	243.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS				ODD Tenor	6Y 24.75				
06M					7Y 27				
09M					8Y 28.5				
01Y									
1.5Y	90.25								
02Y	97			SPRD	5*15Y 18.5				
03Y					10*12Y 04				
04Y					5*10Y 12				
05Y	17/17.5/17.75/18.25/19/18.75/21.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1Y CCS 01								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	92 건	-9	101	77	76	133	74		
금 액	24,433 억원	-26,275	50,708	27,843	24,820	51,770	27,050	22,360	

장중동향

국고채 금리, 장중 큰 변동성을 보인 끝에 상승.

오전 장, 유럽 정치 위험이 부각되면서 미국 채권 금리가 급락함에 따라 국채선물 급등. 아시아시장에서 금리가 상승 되돌림 되면서 국채선물도 상승 폭을 줄여나감. 오후 장, 국채 선물은 독일과 이탈리아, 미국 금리 움직임에 연동되며 큰 변동성을 보인 끝에 장 막판 하락 전환하며 마감.

IRS 금리, 상승. 대외금리 급락에 영향을 받아 오퍼 우위 장세가 이어졌으나 장 후반 아시아시장에서 미국 금리가 오르고 유류 금리도 상승하자 분위기가 반전됨.