IPS Daily Morning Brief

2018-05-09

종가 기준일 2018-05-08

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7525	-0.25	1.7480	1.7340	1.7209	1.7550	1.3900	2.6675	1.2875
9M	1.8250	0.75	1.8115	1.7933	1.7830	1.8250	1.4100	2.6900	1.2500
1Y	1.8925	1.25	1.8745	1.8535	1.8433	1.8925	1.4350	2.7175	1.2200
1.5Y	2.0100	2.00	1.9835	1.9505	1.9481	2.0100	1.4625	2.7825	1.1900
2Y	2.0850	1.75	2.0605	2.0223	2.0276	2.1000	1.4700	2.8475	1.1675
3Y	2.1875	1.75	2.1630	2.1179	2.1319	2.2175	1.5050	2.9775	1.1550
4Y	2.2550	1.25	2.2355	2.1815	2.1991	2.2950	1.5625	3.1050	1.1575
5Y	2.3025	1.00	2.2850	2.2264	2.2455	2.3400	1.6125	3.2125	1.1575
7Y	2.3500	1.00	2.3345	2.2726	2.2967	2.3950	1.6825	3.3550	1.1675
10Y	2.4125	0.75	2.4005	2.3418	2.3699	2.4850	1.7725	3.4975	1.2125
12Y	2.4575	0.75	2.4455	2.3868	2.4133	2.5225	1.8000	3.5375	1.2150
15Y	2.4775	0.75	2.4655	2.4068	2.4327	2.5400	1.7900	3.5550	1.2150
20Y	2.5000	0.75	2.4880	2.4293	2.4535	2.5600	1.7000	3.7050	1.2150

6*9M	7.25	1.00	6.35	5.93	6.21	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	6.75	0.50	6.30	6.03	6.03	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	19.25	0.50	18.60	16.88	18.44	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.25	0.00	10.25	9.56	10.43	13.25	3.50	13.75	-1.75
2*4Y	17.00	-0.50	17.50	15.93	17.15	21.75	8.50	27.75	-1.75
2*5Y	21.75	-0.75	22.45	20.41	21.78	27.25	11.75	38.50	-1.75
3*4Y	6.75	-0.50	7.25	6.36	6.72	8.50	3.25	14.00	-0.50
3*5Y	11.50	-0.75	12.20	10.85	11.35	14.00	6.00	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	-0.25	4.95	4.49	4.63	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	4.95	4.62	5.12	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.00	-0.25	11.55	11.54	12.45	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	-0.25	6.60	6.91	7.33	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.50	4.34	4.50	1.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.50	6.28	6.50	1.50	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.75	8.35	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.884	3.70	1.850	1.848	1.876	1.935	1.400	2.691	1.237
1.5Y	2.082	2.80	2.046	2.015	2.038	2.108	1.517	2.758	1.232
2Y	2.209	2.60	2.175	2.129	2.155	2.230	1.560	2.835	1.225
3Y	2.302	2.20	2.270	2.213	2.241	2.315	1.600	2.930	1.200
4Y	2.472	1.70	2.446	2.390	2.410	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.575	2.00	2.547	2.471	2.486	2.602	1.770	3.320	1.217
7Y	2.685	1.60	2.665	2.597	2.616	2.728	1.965	3.510	1.270
10Y	2.776	1.40	2.761	2.692	2.704	2.812	2.047	3.700	1.355
20Y	2.766	0.40	2.763	2.700	2.705	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	107.48	-0.04	107.45	107.48	107.41
LKTB	119.15	-0.10	119.15	119.25	119.92

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	0.85	-2.45	2.49	0.54	-3.31	9.00	-11.20	11.00	-17.75
1.5Y	-7.20	-0.80	-6.23	-6.48	-8.97	2.40	-15.60	7.00	-19.10
2Y	-12.40	-0.85	-11.49	-10.65	-12.69	-1.35	-18.30	5.50	-25.15
3Y	-11.45	-0.45	-10.68	-9.52	-10.93	4.75	-14.95	5.75	-19.50
4Y	-21.70	-0.45	-21.09	-20.83	-21.04	-8.50	-26.75	2.00	-30.35
5Y	-27.25	-1.00	-26.20	-24.50	-24.04	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.50	-0.60	-33.05	-32.42	-31.91	-21.90	-35.40	-3.75	-37.65
10Y	-36.35	-0.65	-36.03	-35.00	-33.40	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.60	0.35	-27.46	-27.10	-25.17	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-78.75	2.25
-87.00	1.00
-92.00	0.75
-94.75	0.75
-96.50	0.25
-94.75	1.00
-84.00	1.00
-66.75	0.75

CRS

USD/KRW 1076.50 (-0.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1050	3.50	1.6200	0.7650	1*2Y	6.00	-1.00
1.5Y	1.1400	3.00	1.6600	0.8100	2*3Y	7.50	0.00
2Y	1.1650	2.50	1.6950	0.8650	2*5Y	19.00	-0.50
3Y	1.2400	2.50	1.7550	0.9550	3*4Y	5.00	-1.00
4Y	1.2900	1.50	1.8000	1.0150	3*5Y	11.50	-0.50
5Y	1.3550	2.00	1.8500	1.0350	4*5Y	6.50	0.50
7Y	1.5100	2.00	1.8950	1.0400	5*7Y	15.50	0.00
10Y	1.7450	1.50	2.0500	1.0500	5*10Y	39.00	-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	2.5135	0.0083	2.5052	2.5050	2.4762	2.5135	1.1000	2.5135	0.3000
10Y	2.9783	0.0263	2.9520	2.9510	2.9490	3.0282	2.0387	3.0282	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	30.45	-1.77	32.22	32.20	31.62	38.23	-59.60	38.23	-251.80
10Y	20.23	1.23	19.00	18.90	19.20	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	32.75	-1.00	33.75	33.75	34.75	42.50	19.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	56.70	-1.20	57.90	57.90	59.70	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	46.48	1.80	44.68	44.60	47.28	135.50	41.06	260.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	75	ODD Tenor	
09M	82.5 / 82.25 / 82.75		
01Y			
1.5Y	01 / 1.25		
02Y	9.5 / 10	SPRD	6*9m 07 / 7.25
03Y	20.25		
04Y			
05Y	31.75 / 32 / 31.5		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	111 건	-30	141	141	107	82	38	55
금 액	47,180 억원	6,889	40,291	40,291	31,558	20,115	15,520	15,075

장중동향

국고채 금리, 금리 상승.

국채선물은 미국 금리 상승과 국내 금리 인상 우려를 반영해 하락 출발했고 연휴 기간 전해진 이주열 한국은행 총재 매파발언이 약세 요인으로 작용. 동시호가에 국채선물은 상승하며 장중 하락세를 약간 되돌림.

IRS, 금리 상승. 커브 플래트닝.

9m~3Y까지 비드수요가, 4Y 이상 테너는 오퍼수요가 상대적으로 더 많은 분위기.

CRS, 금리 상승.