IPS Daily Morning Brief

2018-04-11

종가 기준일 2018-04-10

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7025	0.00	1.7015	1.7113	1.7070	1.7400	1.3650	2.6700	1.2875
9M	1.7625	0.00	1.7600	1.7711	1.7720	1.8125	1.3400	2.7075	1.2500
1Y	1.8125	0.00	1.8075	1.8279	1.8367	1.8850	1.3250	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9050	0.25	1.9020	1.9311	1.9489	2.0050	1.3100	2.8100	1.1900
2Y	1.9675	0.25	1.9645	2.0080	2.0329	2.1000	1.3000	2.8850	1.1675
3Y	2.0575	0.75	2.0565	2.1111	2.1413	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.1100	0.25	2.1180	2.1770	2.2108	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.1525	0.00	2.1615	2.2204	2.2579	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.2000	-0.50	2.2125	2.2698	2.3116	2.3950	1.3950	3.3800	1.1675
10Y	2.2700	-0.25	2.2795	2.3355	2.3857	2.4850	1.4650	3.5250	1.2125
12Y	2.3150	-0.25	2.3245	2.3805	2.4269	2.5225	1.4750	3.5600	1.2150
15Y	2.3350	-0.25	2.3445	2.4005	2.4450	2.5400	1.4750	3.5825	1.2150
20Y	2.3575	-0.25	2.3670	2.4203	2.4640	2.5600	1.4525	3.7325	1.2150

6*9M	6.00	0.00	5.85	5.99	6.51	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	5.00	0.00	4.75	5.68	6.47	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	15.50	0.25	15.70	18.01	19.62	23.00	-2.50	23.00	-5.50
2*3Y	9.00	0.50	9.20	10.31	10.85	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	14.25	0.00	15.35	16.90	17.80	21.75	2.25	27.75	-1.75
2*5Y	18.50	-0.25	19.70	21.24	22.50	27.25	4.75	38.50	-1.75
3*4Y	5.25	-0.50	6.15	6.59	6.95	8.50	2.25	14.00	-0.50
3*5Y	9.50	-0.75	10.50	10.93	11.65	14.00	4.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	-0.25	4.35	4.34	4.70	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	-0.50	5.10	4.94	5.37	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.75	-0.25	11.80	11.51	12.78	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.25	6.70	6.58	7.41	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.50	4.13	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.50	5.93	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.48	7.83	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.855	0.10	1.851	1.895	1.873	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.010	0.90	1.997	2.032	2.041	2.108	1.415	2.820	1.232
2Y	2.105	0.80	2.095	2.142	2.166	2.230	1.390	2.910	1.225
3Y	2.180	1.00	2.168	2.225	2.252	2.315	1.385	3.040	1.200
4Y	2.338	0.10	2.337	2.407	2.417	2.502	1.477	3.275	1.232
5Y	2.405	0.30	2.398	2.450	2.499	2.602	1.469	3.410	1.217
7Y	2.525	0.10	2.525	2.576	2.631	2.728	1.576	3.563	1.270
10Y	2.607	-0.30	2.613	2.662	2.713	2.812	1.650	3.750	1.355
20Y	2.620	-0.20	2.636	2.665	2.693	2.792	1.750	3.935	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	107.90	107.94	107.78
LKTB	120.68	0.04	120.77	120.92	120.45

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	-4.25	-0.10	-4.35	-6.74	-3.63	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-10.50	-0.65	-9.48	-10.08	-9.25	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.75	-0.55	-13.07	-13.36	-13.29	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.25	-0.25	-11.19	-11.39	-11.02	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-22.80	0.15	-21.92	-23.00	-20.58	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-25.25	-0.30	-23.67	-22.97	-24.11	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.50	-0.60	-31.23	-30.65	-31.96	-17.60	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.70	0.05	-33.35	-32.70	-32.77	-18.50	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.25	-0.05	-26.88	-24.43	-22.87	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-67.25	-1.50
-69.00	-2.75
-66.75	-2.75
-62.25	-3.25
-61.00	-3.25
-58.75	-2.50
-50.50	-2.00
-39.50	-2.25

CRS

USD/KRW 1066.40 (-0.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1400	-1.50	1.6200	0.7650	1*2Y	16.00	-1.00
1.5Y	1.2150	-2.50	1.6600	0.9100	2*3Y	13.50	0.00
2Y	1.3000	-2.50	1.6950	0.8850	2*5Y	26.50	0.00
3Y	1.4350	-2.50	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	-0.50
4Y	1.5000	-3.00	1.8000	0.8400	3*5Y	13.00	0.00
5Y	1.5650	-2.50	1.8500	0.8350	4*5Y	6.50	0.50
7Y	1.6950	-2.50	1.8950	0.8050	5*7Y	13.00	0.00
10Y	1.8750	-2.50	2.0500	0.8100	5*10Y	31.00	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	2.3111	0.0286	2.2825	2.2702	2.3067	2.3489	0.8100	2.3489	0.2800
10Y	2.8030	0.0229	2.7801	2.7774	2.8313	2.9500	1.8300	3.0300	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	20.61	2.06	18.55	18.02	20.97	20.97	-70.50	20.97	-263.00
10Y	19.60	2.59	17.01	17.54	19.53	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	30.25	-0.50	30.75	31.00	33.50	42.50	16.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	50.20	-1.10	51.30	51.20	53.90	68.70	26.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	49.19	-0.57	49.76	50.72	52.46	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	80.75		
1.5Y	89.75		
02Y	97.25	SPRD	4*5Y 4.25
03Y	4.5 / 4.25 / 5.75 / 06 / 6.25		5*10Y 11.75
04Y			3*6Y 12.5
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3y CCS 43		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	61 건	12	49	97	111	87	46	34
금 액	13,088 억원	-5,019	18,107	26,635	28,915	34,930	15,655	7,964

장중동향

국고채 금리, 상승.
무역 분쟁 우려가 지속함에 따라 안전자산 선호 분위기가 이어지며 강세를 보이던 국채선물은 오전 11시경 전해진 이일형 금융통화위원의 발언에 약세 전환. 장 후반에는 다시 강세 압력이 강해졌음.

IRS, 5년이하 테너 소폭 상승하였으니 5년 초과 구간은 하락 마감.
금통위를 앞두고 거래가 많지 않았으나 선물대비 강세.

CRS, 하락 마감.