

IPS Daily Morning Brief

2018-04-02

종가 기준일 2018-03-30

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7125	0.00	1.7130	1.7229	1.7077	1.7400	1.3650	2.6700	1.2875
9M	1.7725	0.00	1.7730	1.7854	1.7745	1.8125	1.3400	2.7075	1.2500
1Y	1.8300	0.00	1.8315	1.8470	1.8418	1.8850	1.3250	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9300	-0.50	1.9340	1.9571	1.9551	2.0050	1.3100	2.8100	1.1900
2Y	2.0025	-0.50	2.0115	2.0408	2.0400	2.1000	1.3000	2.8850	1.1675
3Y	2.1000	-1.00	2.1175	2.1476	2.1477	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.1600	-1.25	2.1820	2.2141	2.2160	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.2000	-1.25	2.2235	2.2570	2.2626	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.2475	-1.25	2.2730	2.3069	2.3149	2.3950	1.3950	3.3800	1.1675
10Y	2.3000	-2.00	2.3325	2.3765	2.3881	2.4850	1.4650	3.5250	1.2125
12Y	2.3450	-2.00	2.3775	2.4208	2.4292	2.5225	1.4750	3.5600	1.2150
15Y	2.3650	-2.00	2.3975	2.4406	2.4465	2.5400	1.4750	3.5825	1.2150
20Y	2.3875	-2.00	2.4190	2.4595	2.4637	2.5600	1.4525	3.7325	1.2150

6*9M	6.00	0.00	6.00	6.25	6.68	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	5.75	0.00	5.85	6.16	6.73	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	17.25	-0.50	18.00	19.38	19.82	23.00	-2.50	23.00	-5.50
2*3Y	9.75	-0.50	10.60	10.69	10.78	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	15.75	-0.75	17.05	17.34	17.61	21.75	2.25	27.75	-1.75
2*5Y	19.75	-0.75	21.20	21.63	22.26	27.25	4.75	38.50	-1.75
3*4Y	6.00	-0.25	6.45	6.65	6.83	8.50	2.00	14.00	-0.50
3*5Y	10.00	-0.25	10.60	10.94	11.49	14.00	4.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.00	4.15	4.29	4.65	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	4.95	4.99	5.23	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	10.00	-0.75	10.90	11.95	12.55	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	5.25	-0.75	5.95	6.96	7.33	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.43	4.10	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.41	5.84	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.65	8.30	7.55	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.897	-0.50	1.899	1.915	1.869	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.028	-0.30	2.031	2.062	2.041	2.108	1.415	2.820	1.232
2Y	2.135	-0.20	2.140	2.179	2.168	2.230	1.390	2.920	1.225
3Y	2.217	-0.30	2.226	2.266	2.251	2.315	1.385	3.050	1.200
4Y	2.392	-1.10	2.413	2.440	2.416	2.502	1.477	3.280	1.232
5Y	2.425	-1.00	2.444	2.496	2.501	2.602	1.469	3.410	1.217
7Y	2.542	-1.30	2.568	2.623	2.633	2.728	1.576	3.563	1.270
10Y	2.622	-1.50	2.652	2.705	2.712	2.812	1.650	3.750	1.355
20Y	2.635	0.30	2.651	2.700	2.682	2.792	1.750	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.50	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.71	0.01	107.73	107.74	107.65
LKTb	120.51	0.16	120.47	120.60	120.33

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	-6.70	0.50	-6.75	-6.79	-2.74	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-9.80	-0.20	-9.66	-10.48	-8.60	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.25	-0.30	-12.87	-13.87	-12.77	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.70	-0.70	-10.83	-11.86	-10.34	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-23.20	-0.15	-23.06	-22.61	-20.02	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-22.50	-0.25	-22.07	-23.86	-23.85	-6.95	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.45	0.05	-29.48	-31.62	-31.85	-13.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.20	-0.50	-31.97	-32.83	-32.37	-15.45	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.75	-2.30	-23.18	-24.05	-21.85	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1063.50 (-2.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-57.00	-4.00	1Y	1.2600	-4.00	1.6200	0.7650	1*2Y	12.00	1.50	
-61.00	-3.00	1.5Y	1.3200	-3.50	1.6600	0.9100	2*3Y	10.50	1.00	
-62.25	-2.00	2Y	1.3800	-2.50	1.6950	0.8850	2*5Y	23.00	1.00	
-61.50	-0.50	3Y	1.4850	-1.50	1.7550	0.8550	3*4Y	5.00	0.00	
-62.50	-0.25	4Y	1.5350	-1.50	1.8000	0.8400	3*5Y	12.50	0.00	
-59.00	-0.25	5Y	1.6100	-1.50	1.8500	0.8350	4*5Y	7.50	0.00	
-51.75	-0.25	7Y	1.7300	-1.50	1.8950	0.8050	5*7Y	12.00	0.00	
-40.00	0.50	10Y	1.9000	-1.50	2.0500	0.8100	5*10Y	29.00	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	2.2661	0.0000	2.2661	2.2942	2.2741	2.3489	0.7800	2.3489	0.2800
10Y	2.7392	0.0000	2.7392	2.7846	2.7773	2.9500	1.7800	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	13.11	0.2	12.91	15.72	13.21	15.72	-70.50	15.72	-264.00
10Y	11.72	1.50	10.22	14.26	10.73	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	29.75	-1.50	31.25	31.25	33.50	42.50	16.00	68.25	2.75
KTb 2*10Y	48.70	-1.30	50.00	50.50	52.80	68.70	23.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	47.31	0.00	47.31	49.04	50.32	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	82.75								
1.5Y									
02Y		SPRD	3*10Y 20						
03Y	11 / 11.25		5*10Y 10						
04Y									
05Y	19.75								
07Y									
10Y	30								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	41 건	-30	71	86	108	70	135	145	
금 액	10,335 억원	-12,522	22,857	24,100	29,500	15,675	43,437	40,690	

장중동향
국고채 금리 하락마감.
외국인의 국채선물 순매수와 분기 말 원도드레싱 매수가 더해졌음.

IRS, 1년을 제외한 구간에서 하락마감.
커브플래트닝. 특히 5년 이상 구간에 오폰 수요가 많았음.

CRS, 전체적으로 하락마감.
단기가 장기보다 더 내려 커브스티프닝.