

IPS Daily Morning Brief

2018-04-05

종가 기준일 2018-04-04

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6975	-0.25	1.7080	1.7181	1.7077	1.7400	1.3650	2.6700	1.2875
9M	1.7550	-0.25	1.7670	1.7788	1.7739	1.8125	1.3400	2.7075	1.2500
1Y	1.8000	-1.00	1.8210	1.8385	1.8404	1.8850	1.3250	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9000	-1.25	1.9225	1.9473	1.9537	2.0050	1.3100	2.8100	1.1900
2Y	1.9600	-2.50	1.9925	2.0286	2.0384	2.1000	1.3000	2.8850	1.1675
3Y	2.0600	-2.75	2.0930	2.1350	2.1469	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.1275	-2.50	2.1565	2.2020	2.2159	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.1675	-2.50	2.1965	2.2450	2.2625	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.2175	-2.50	2.2450	2.2944	2.3151	2.3950	1.3950	3.3800	1.1675
10Y	2.2800	-2.25	2.3035	2.3619	2.3885	2.4850	1.4650	3.5250	1.2125
12Y	2.3250	-2.25	2.3485	2.4066	2.4298	2.5225	1.4750	3.5600	1.2150
15Y	2.3450	-2.25	2.3685	2.4266	2.4475	2.5400	1.4750	3.5825	1.2150
20Y	2.3675	-2.25	2.3910	2.4459	2.4656	2.5600	1.4525	3.7325	1.2150

6*9M	5.75	0.00	5.90	6.06	6.63	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	4.50	-0.75	5.40	5.98	6.65	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	16.00	-1.50	17.15	19.01	19.80	23.00	-2.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.00	-0.25	10.05	10.64	10.85	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	16.75	0.00	16.40	17.34	17.75	21.75	2.25	27.75	-1.75
2*5Y	20.75	0.00	20.40	21.64	22.40	27.25	4.75	38.50	-1.75
3*4Y	6.75	0.25	6.35	6.70	6.90	8.50	2.25	14.00	-0.50
3*5Y	10.75	0.25	10.35	11.00	11.55	14.00	4.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.00	4.00	4.30	4.65	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	5.00	0.00	4.85	4.94	5.27	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.25	0.25	10.70	11.69	12.60	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.25	5.85	6.75	7.34	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.48	4.13	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.48	5.90	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.40	7.71	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.856	-2.70	1.887	1.911	1.872	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	1.985	-2.90	2.017	2.051	2.042	2.108	1.415	2.820	1.232
2Y	2.087	-2.00	2.119	2.164	2.168	2.230	1.390	2.920	1.225
3Y	2.160	-3.50	2.202	2.250	2.253	2.315	1.385	3.050	1.200
4Y	2.336	-4.10	2.381	2.431	2.419	2.502	1.477	3.280	1.232
5Y	2.390	-3.70	2.422	2.478	2.502	2.602	1.469	3.410	1.217
7Y	2.520	-3.00	2.544	2.605	2.634	2.728	1.576	3.563	1.270
10Y	2.610	-2.70	2.629	2.689	2.714	2.812	1.650	3.750	1.355
20Y	2.652	-3.40	2.653	2.689	2.688	2.792	1.750	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.50	4.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.89	0.11	107.76	107.91	107.76
LKTb	120.65	0.23	120.33	120.66	120.30

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	-5.60	1.70	-6.60	-7.27	-3.19	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-8.50	1.65	-9.49	-10.39	-8.86	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-12.70	-0.50	-12.67	-13.52	-12.99	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-10.00	0.75	-10.88	-11.47	-10.62	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-20.85	1.60	-22.41	-22.92	-20.27	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-22.25	1.20	-22.59	-23.29	-23.96	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-30.25	0.50	-29.92	-31.02	-31.93	-16.75	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.00	0.45	-32.51	-32.68	-32.57	-18.00	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-28.45	1.15	-26.22	-24.28	-22.24	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1059.80 (+5.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-68.00	5.50	1Y	1.1200	4.50	1.6200	0.7650	1*2Y	18.50	0.50		
-69.00	5.75	1.5Y	1.2100	4.50	1.6600	0.9100	2*3Y	13.50	1.00		
-65.50	7.50	2Y	1.3050	5.00	1.6950	0.8850	2*5Y	29.00	2.50		
-62.00	8.75	3Y	1.4400	6.00	1.7550	0.8550	3*4Y	7.50	1.00		
-61.25	9.50	4Y	1.5150	7.00	1.8000	0.8400	3*5Y	15.50	1.50		
-57.25	10.00	5Y	1.5950	7.50	1.8500	0.8350	4*5Y	8.00	0.50		
-47.75	12.00	7Y	1.7400	9.50	1.8950	0.8050	5*7Y	14.50	2.00		
-35.50	13.25	10Y	1.9250	11.00	2.0500	0.8100	5*10Y	33.00	3.50		

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	2.2945	0.0081	2.2864	2.2379	2.2661	2.3489	0.7800	2.3489	0.2800
10Y	2.8066	0.0265	2.7801	2.7382	2.7392	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	20.75	2.81	17.94	10.79	13.11	20.75	-70.50	20.75	-264.00
10Y	19.66	5.35	14.31	10.12	11.72	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	32.00	0.25	31.75	30.75	29.75	42.50	16.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	52.30	-0.70	53.00	50.70	48.70	68.70	23.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	51.21	1.84	49.37	50.03	47.31	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	70									
09M	75.5									
01Y										
1.5Y										
02Y	98				SPRD	2*5Y 20.5 / 20.75 / 21				
03Y						7*10Y 06				
04Y	15									
05Y	18 / 19									
07Y										
10Y	28									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			87 건	41	46	34	41	71	86	108
금 액			34,930 억원	19,275	15,655	7,964	10,335	22,857	24,100	29,500

장종동향

IRS, 현선물만큼 강세를 보이며 전반적 금리 하락.
전구간 비드를 찾기 힘든 가운데 5Y 거래 다수.

CRS, 금리 상승. 커브 스티프닝.
7Y,10Y 등 장기구간으로 부채 스왑 포지션이 나오면서 금리 상승.