IPS Daily Morning Brief

2018-04-08

종가 기준일 2018-04-06

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7000	-0.50	1.7040	1.7144	1.7075	1.7400	1.3650	2.6700	1.2875
9M	1.7575	-0.50	1.7620	1.7745	1.7733	1.8125	1.3400	2.7075	1.2500
1Y	1.8025	-0.75	1.8115	1.8325	1.8391	1.8850	1.3250	2.7450	1.2200
1.5Y	1.8950	-1.25	1.9100	1.9389	1.9521	2.0050	1.3100	2.8100	1.1900
2Y	1.9575	-1.50	1.9765	2.0185	2.0366	2.1000	1.3000	2.8850	1.1675
3Y	2.0425	-3.00	2.0740	2.1236	2.1452	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.1025	-4.00	2.1390	2.1910	2.2145	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.1475	-4.00	2.1810	2.2345	2.2613	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.2000	-4.00	2.2315	2.2840	2.3143	2.3950	1.3950	3.3800	1.1675
10Y	2.2675	-4.00	2.2945	2.3505	2.3880	2.4850	1.4650	3.5250	1.2125
12Y	2.3125	-4.00	2.3395	2.3955	2.4292	2.5225	1.4750	3.5600	1.2150
15Y	2.3325	-4.00	2.3595	2.4155	2.4471	2.5400	1.4750	3.5825	1.2150
20Y	2.3550	-4.00	2.3820	2.4350	2.4658	2.5600	1.4525	3.7325	1.2150

6*9M	5.75	0.00	5.80	6.01	6.58	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	4.50	-0.25	4.95	5.80	6.58	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	15.50	-0.75	16.50	18.60	19.75	23.00	-2.50	23.00	-5.50
2*3Y	8.50	-1.50	9.75	10.51	10.86	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	14.50	-2.50	16.25	17.25	17.79	21.75	2.25	27.75	-1.75
2*5Y	19.00	-2.50	20.45	21.60	22.47	27.25	4.75	38.50	-1.75
3*4Y	6.00	-1.00	6.50	6.74	6.93	8.50	2.25	14.00	-0.50
3*5Y	10.50	-1.00	10.70	11.09	11.61	14.00	4.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.20	4.35	4.68	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	5.25	0.00	5.05	4.95	5.31	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	12.00	0.00	11.35	11.60	12.67	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	0.00	6.30	6.65	7.36	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	5.91	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.45	7.78	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.844	-0.20	1.865	1.903	1.873	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	1.993	-0.20	2.003	2.040	2.043	2.108	1.415	2.820	1.232
2Y	2.090	-0.70	2.102	2.152	2.168	2.230	1.390	2.920	1.225
3Y	2.162	-0.80	2.181	2.237	2.253	2.315	1.385	3.050	1.200
4Y	2.325	-2.50	2.357	2.423	2.419	2.502	1.477	3.280	1.232
5Y	2.387	-2.00	2.409	2.465	2.501	2.602	1.469	3.410	1.217
7Y	2.513	-2.90	2.536	2.591	2.634	2.728	1.576	3.563	1.270
10Y	2.602	-3.40	2.624	2.677	2.715	2.812	1.650	3.750	1.355
20Y	2.625	-3.50	2.657	2.678	2.691	2.792	1.750	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.45	-5.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.90	0.06	107.88	107.96	107.86
LKTB	120.71	0.35	120.49	120.79	120.40

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	-4.15	-0.55	-5.37	-7.03	-3.39	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-9.80	-1.05	-9.32	-10.13	-9.04	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.25	-0.80	-12.57	-13.39	-13.14	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.95	-2.20	-10.68	-11.37	-10.81	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-22.25	-1.50	-21.76	-23.21	-20.43	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.95	-2.00	-22.82	-23.05	-24.01	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.30	-1.10	-30.43	-30.73	-31.94	-17.60	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.45	-0.60	-32.99	-32.62	-32.68	-18.50	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-27.00	-0.50	-27.48	-24.34	-22.53	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-65.75	-0.25
-67.00	1.75
-65.75	2.00
-61.75	3.50
-61.25	3.50
-59.75	2.50
-51.50	1.50
-40.25	1.50

CRS

USD/KRW 1069.60 (+9.90)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1450	-1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	15.50	1.50
1.5Y	1.2250	0.50	1.6600	0.9100	2*3Y	12.50	0.00
2Y	1.3000	0.50	1.6950	0.8850	2*5Y	25.00	-2.00
3Y	1.4250	0.50	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	-1.00
4Y	1.4900	-0.50	1.8000	0.8400	3*5Y	12.50	-2.00
5Y	1.5500	-1.50	1.8500	0.8350	4*5Y	6.00	-1.00
7Y	1.6850	-2.50	1.8950	0.8050	5*7Y	13.50	-1.00
10Y	1.8650	-2.50	2.0500	0.8100	5*10Y	31.50	-1.00

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	2.2702	-0.0365	2.3067	2.2945	2.2864	2.3489	0.7800	2.3489	0.2800
10Y	2.7774	-0.0539	2.8313	2.8066	2.7801	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	18.02	-2.95	20.97	20.75	17.94	20.97	-70.50	20.97	-264.00
10Y	17.54	-1.99	19.53	19.66	14.31	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	31.00	-2.50	33.50	32.00	31.75	42.50	16.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	51.20	-2.70	53.90	52.30	53.00	68.70	26.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	50.72	-1.74	52.46	51.21	49.37	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	80.75		
1.5Y	90.25		
02Y	96.75	SPRD	1*2y 16
03Y	4.5		2*5y 19.5
04Y	17.5		3*5y 11.5
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	97 건	-14	111	87	46	34	41	71
금 액	26,635 억원	-2,280	28,915	34,930	15,655	7,964	10,335	22,857

장중동향

국고채 금리 하락. 미국 트럼프 대통령의 추가관세 뉴스로 무역전쟁 우려로 안전자산선호. 국채선물은 외국인의 매수세가 계속 됨.

IRS는 현물보다 더 강세를 보이며 레벨 하락. 전체적으로 오퍼리시했고, 특히 5년으로 오퍼가 많이 나오면서 거래가 많았음. 장기쪽이 더욱 강세를 보이며 커브 플랫마감.

CRS는 1.5~3년을 제외하고 하락.