

IPS Daily Morning Brief

2018-04-10

종가 기준일 2018-04-09

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7025	0.25	1.7010	1.7128	1.7072	1.7400	1.3650	2.6700	1.2875
9M	1.7625	0.50	1.7590	1.7728	1.7727	1.8125	1.3400	2.7075	1.2500
1Y	1.8125	1.00	1.8070	1.8301	1.8379	1.8850	1.3250	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9025	0.75	1.9035	1.9348	1.9504	2.0050	1.3100	2.8100	1.1900
2Y	1.9650	0.75	1.9680	2.0130	2.0346	2.1000	1.3000	2.8850	1.1675
3Y	2.0500	0.75	2.0625	2.1170	2.1430	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.1075	0.50	2.1265	2.1838	2.2124	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.1525	0.50	2.1695	2.2273	2.2594	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.2050	0.50	2.2210	2.2769	2.3128	2.3950	1.3950	3.3800	1.1675
10Y	2.2725	0.50	2.2860	2.3429	2.3867	2.4850	1.4650	3.5250	1.2125
12Y	2.3175	0.50	2.3310	2.3879	2.4279	2.5225	1.4750	3.5600	1.2150
15Y	2.3375	0.50	2.3510	2.4079	2.4459	2.5400	1.4750	3.5825	1.2150
20Y	2.3600	0.50	2.3735	2.4275	2.4648	2.5600	1.4525	3.7325	1.2150

6*9M	6.00	0.25	5.80	6.00	6.55	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	5.00	0.50	4.80	5.74	6.52	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	15.25	-0.25	16.10	18.29	19.68	23.00	-2.50	23.00	-5.50
2*3Y	8.50	0.00	9.45	10.40	10.84	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	14.25	-0.25	15.85	17.08	17.78	21.75	2.25	27.75	-1.75
2*5Y	18.75	-0.25	20.15	21.43	22.48	27.25	4.75	38.50	-1.75
3*4Y	5.75	-0.25	6.40	6.68	6.94	8.50	2.25	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	-0.25	10.70	11.03	11.63	14.00	4.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.30	4.35	4.70	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	5.25	0.00	5.15	4.96	5.35	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	12.00	0.00	11.65	11.56	12.73	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	0.00	6.50	6.60	7.38	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	5.92	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.46	7.81	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.854	1.00	1.857	1.899	1.873	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.001	0.80	1.998	2.036	2.042	2.108	1.415	2.820	1.232
2Y	2.097	0.70	2.096	2.147	2.167	2.230	1.390	2.920	1.225
3Y	2.170	0.80	2.171	2.231	2.252	2.315	1.385	3.050	1.200
4Y	2.337	1.20	2.345	2.415	2.418	2.502	1.477	3.280	1.232
5Y	2.402	1.50	2.403	2.457	2.500	2.602	1.469	3.410	1.217
7Y	2.524	1.10	2.530	2.583	2.632	2.728	1.576	3.563	1.270
10Y	2.610	0.80	2.619	2.669	2.714	2.812	1.650	3.750	1.355
20Y	2.622	-0.30	2.649	2.671	2.692	2.792	1.750	3.943	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.87	-0.03	107.94	107.94	107.84
LKTb	120.64	-0.07	120.94	120.95	120.58

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	-4.15	0.00	-4.96	-6.90	-3.51	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-9.85	-0.05	-9.41	-10.10	-9.14	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.20	0.05	-12.76	-13.36	-13.22	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.00	-0.05	-10.89	-11.38	-10.92	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-22.95	-0.70	-21.85	-23.11	-20.52	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-24.95	-1.00	-23.31	-22.98	-24.06	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.90	-0.60	-30.88	-30.66	-31.95	-17.60	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.75	-0.30	-33.30	-32.65	-32.72	-18.50	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.20	0.80	-27.55	-24.35	-22.71	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1067.10 (-2.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-65.75	0.00	1Y	1.1550	1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	17.00	1.50		
-66.25	0.75	1.5Y	1.2400	1.50	1.6600	0.9100	2*3Y	13.50	1.00		
-64.00	1.75	2Y	1.3250	2.50	1.6950	0.8850	2*5Y	26.50	1.50		
-59.00	2.75	3Y	1.4600	3.50	1.7550	0.8550	3*4Y	7.00	0.50		
-57.75	3.50	4Y	1.5300	4.00	1.8000	0.8400	3*5Y	13.00	0.50		
-56.25	3.50	5Y	1.5900	4.00	1.8500	0.8350	4*5Y	6.00	0.00		
-48.50	3.00	7Y	1.7200	3.50	1.8950	0.8050	5*7Y	13.00	-0.50		
-37.25	3.00	10Y	1.9000	3.50	2.0500	0.8100	5*10Y	31.00	-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	2.2825	0.0123	2.2702	2.3067	2.2945	2.3489	0.7800	2.3489	0.2800
10Y	2.7801	0.0027	2.7774	2.8313	2.8066	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	18.55	0.53	18.02	20.97	20.75	20.97	-70.50	20.97	-264.00
10Y	17.01	-0.53	17.54	19.53	19.66	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	30.75	-0.25	31.00	33.50	32.00	42.50	16.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	51.30	0.10	51.20	53.90	52.30	68.70	26.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	49.76	-0.96	50.72	52.46	51.21	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	81								
1.5Y	90.25								
02Y		SPRD	6*12M	10.5 / 10.75					
03Y	4.5 / 4.75		1*2Y	15.5					
04Y	11		1*3Y	24					
05Y	15 / 15.25		2*3Y	8.5					
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y CCS 45								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	49 건	-48	97	111	87	46	34	41	
금 액	18,107 억원	-8,528	26,635	28,915	34,930	15,655	7,964	10,335	

장종동향

국고채 금리, 대부분 구간에서 금리가 올랐지만 초장기물 금리가 소폭 하락하며 커브 플랫트닝.

IRS, 전반적으로 금리 상승 마감.
금통위를 앞두고 거래가 많지 않았으나 1Y-3Y 구간을 위주로 일부 거래. 오퍼리시 했던 장.

CRS, 금리 상승. 커브 스티프닝.
장기 구간으로 부채 스왑 태핑 영향을 받아 금리 상승.