

IPS Daily Morning Brief

2018-04-16

종가 기준일 2018-04-13

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7250	-0.50	1.7110	1.7104	1.7085	1.7400	1.3900	2.6700	1.2875
9M	1.7775	-0.25	1.7680	1.7696	1.7728	1.8125	1.3925	2.6925	1.2500
1Y	1.8325	0.50	1.8205	1.8255	1.8363	1.8850	1.3925	2.7275	1.2200
1.5Y	1.9200	0.75	1.9095	1.9245	1.9473	2.0050	1.3975	2.8025	1.1900
2Y	1.9775	1.00	1.9685	1.9969	2.0303	2.1000	1.4050	2.8750	1.1675
3Y	2.0650	1.75	2.0535	2.0969	2.1384	2.2175	1.4475	3.0150	1.1550
4Y	2.1150	2.00	2.1045	2.1595	2.2075	2.2950	1.4900	3.1350	1.1575
5Y	2.1550	2.25	2.1455	2.2020	2.2545	2.3400	1.5300	3.2275	1.1575
7Y	2.1975	2.50	2.1905	2.2503	2.3085	2.3950	1.6025	3.3650	1.1675
10Y	2.2700	2.75	2.2605	2.3155	2.3832	2.4850	1.7000	3.5100	1.2125
12Y	2.3150	2.75	2.3055	2.3605	2.4245	2.5225	1.7175	3.5450	1.2150
15Y	2.3350	2.75	2.3255	2.3805	2.4428	2.5400	1.7175	3.5675	1.2150
20Y	2.3575	2.75	2.3480	2.4006	2.4621	2.5600	1.6900	3.7175	1.2150

6*9M	5.25	0.25	5.70	5.93	6.43	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	5.50	0.75	5.25	5.59	6.35	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	14.50	0.50	14.80	17.14	19.40	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	8.75	0.75	8.50	10.00	10.81	13.25	3.00	14.00	-1.75
2*4Y	13.75	1.00	13.60	16.26	17.72	21.75	7.00	27.75	-1.75
2*5Y	17.75	1.25	17.70	20.51	22.42	27.25	9.75	38.50	-1.75
3*4Y	5.00	0.25	5.10	6.26	6.91	8.50	2.75	14.00	-0.50
3*5Y	9.00	0.50	9.20	10.51	11.61	14.00	5.25	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.25	4.10	4.25	4.70	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.25	0.25	4.50	4.83	5.40	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.50	0.50	11.50	11.35	12.87	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.25	0.25	7.00	6.53	7.47	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	5.96	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.51	7.90	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.836	-1.00	1.848	1.883	1.874	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	1.992	-1.30	2.003	2.022	2.041	2.108	1.471	2.820	1.232
2Y	2.077	0.00	2.088	2.125	2.164	2.230	1.495	2.885	1.225
3Y	2.155	0.50	2.162	2.208	2.250	2.315	1.520	3.005	1.200
4Y	2.321	0.90	2.326	2.386	2.415	2.502	1.662	3.255	1.232
5Y	2.385	1.00	2.390	2.433	2.496	2.602	1.680	3.385	1.217
7Y	2.516	1.90	2.513	2.558	2.628	2.728	1.836	3.545	1.270
10Y	2.607	3.00	2.597	2.644	2.711	2.812	1.950	3.730	1.355
20Y	2.605	1.90	2.608	2.651	2.694	2.792	2.045	3.920	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.92	-0.04	107.92	107.97	107.91
LKTb	120.71	-0.34	120.85	121.00	120.71

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-0.35	1.50	-2.79	-5.72	-3.76	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-7.20	2.05	-9.37	-9.71	-9.38	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-9.95	1.00	-11.91	-12.81	-13.37	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-9.00	1.25	-10.89	-11.11	-11.16	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-20.60	1.10	-22.11	-22.67	-20.73	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.00	1.25	-24.49	-23.06	-24.15	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.85	0.60	-32.25	-30.77	-31.93	-21.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.70	-0.25	-33.61	-32.86	-32.81	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.75	0.85	-26.00	-25.04	-23.18	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1069.50 (0.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-72.75	-0.50	1Y	1.1050	0.00	1.6200	0.7650	1*2Y	14.50	-2.00		
-74.50	-1.75	1.5Y	1.1750	-1.00	1.6600	0.9100	2*3Y	13.00	0.00		
-72.75	-3.00	2Y	1.2500	-2.00	1.6950	0.9050	2*5Y	24.50	-1.50		
-68.50	-3.75	3Y	1.3800	-2.00	1.7550	0.9400	3*4Y	6.00	-0.50		
-67.50	-4.50	4Y	1.4400	-2.50	1.8000	0.9600	3*5Y	11.50	-1.50		
-66.00	-5.75	5Y	1.4950	-3.50	1.8500	0.9800	4*5Y	5.50	-1.00		
-57.75	-6.00	7Y	1.6200	-3.50	1.8950	0.9900	5*7Y	12.50	0.00		
-47.00	-6.25	10Y	1.8000	-3.50	2.0500	1.0000	5*10Y	30.50	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	2.3484	-0.0038	2.3522	2.3111	2.3111	2.3522	0.9150	2.3522	0.3000
10Y	2.8262	-0.0138	2.8400	2.7829	2.8030	2.9500	2.0387	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	27.14	-0.38	27.52	22.91	20.61	27.52	-70.50	27.52	-258.50
10Y	21.92	-4.38	26.30	20.09	19.60	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	29.25	1.75	27.50	28.25	30.25	42.50	19.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	53.00	3.00	50.00	50.00	50.20	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	47.78	-1.00	48.78	47.18	49.19	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M	72.5								
09M									
01Y	83								
1.5Y									
02Y	97.25 / 97.5	SPRD	4*6Y 06						
03Y	5.25 / 5.5		4*7Y 7.75						
04Y	10.5		6*7Y 1.75						
05Y	13.75		8*12Y 09						
07Y			6*12M 10.75 / 10.5 / 10.25						
10Y			6*9M 5.25						
12Y			9*12M 05						
15Y									
20Y									
CRS	4Y CCS 45.5 / 44								
	5Y CCS 49.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	124 건	20	104	117	61	49	97	111	
금 액	36,215 억원	-15,346	51,561	37,217	13,088	18,107	26,635	28,915	

장중동향
국고채 금리, 중장기물을 중심으로 상승.
미국 채권금리 상승을 반영한 가운데 외국인의 3년 국채선물 매수가 다소 둔화된 영향을 받음.

IRS 금리, 상승.
커브 스티프닝. 비드 수요가 상대적으로 더 많았음.

CRS 금리, 1년을 제외한 구간에서 하락.
커브 플랫트닝. 뒤쪽 구간에서 에셋물량이 나와 하락마감.