

IPS Daily Morning Brief

2018-04-23

종가 기준일 2018-04-20

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7350	0.75	1.7280	1.7140	1.7117	1.7400	1.3900	2.6700	1.2875
9M	1.7900	0.50	1.7840	1.7718	1.7750	1.8125	1.4100	2.6925	1.2500
1Y	1.8475	0.75	1.8395	1.8258	1.8366	1.8850	1.4350	2.7225	1.2200
1.5Y	1.9375	0.25	1.9320	1.9214	1.9458	2.0050	1.4625	2.7875	1.1900
2Y	2.0150	1.25	2.0005	1.9893	2.0281	2.1000	1.4700	2.8525	1.1675
3Y	2.1025	1.25	2.0885	2.0834	2.1356	2.2175	1.5050	2.9825	1.1550
4Y	2.1600	1.50	2.1430	2.1421	2.2042	2.2950	1.5625	3.1075	1.1575
5Y	2.2050	1.75	2.1860	2.1840	2.2515	2.3400	1.6125	3.2125	1.1575
7Y	2.2475	2.00	2.2275	2.2306	2.3050	2.3950	1.6825	3.3550	1.1675
10Y	2.3175	2.00	2.2990	2.2966	2.3803	2.4850	1.7700	3.4975	1.2125
12Y	2.3625	2.00	2.3440	2.3416	2.4221	2.5225	1.7775	3.5375	1.2150
15Y	2.3825	2.00	2.3640	2.3616	2.4408	2.5400	1.7775	3.5550	1.2150
20Y	2.4050	2.00	2.3865	2.3839	2.4606	2.5600	1.7000	3.7050	1.2150

6*9M	5.50	-0.25	5.60	5.78	6.33	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	5.75	0.25	5.55	5.40	6.15	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	16.75	0.50	16.10	16.35	19.15	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	8.75	0.00	8.80	9.41	10.75	13.25	3.00	13.75	-1.75
2*4Y	14.50	0.25	14.25	15.29	17.60	21.75	7.00	27.75	-1.75
2*5Y	19.00	0.50	18.55	19.48	22.33	27.25	9.75	38.50	-1.75
3*4Y	5.75	0.25	5.45	5.88	6.86	8.50	2.75	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.50	9.75	10.06	11.59	14.00	5.25	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.25	4.30	4.19	4.73	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.25	0.25	4.15	4.66	5.35	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.25	0.25	11.30	11.26	12.89	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.00	7.15	6.60	7.53	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.50	4.18	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.50	6.05	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.73	8.03	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.850	0.70	1.845	1.864	1.876	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.001	0.50	1.995	2.008	2.041	2.108	1.517	2.785	1.232
2Y	2.117	0.70	2.107	2.109	2.162	2.230	1.560	2.845	1.225
3Y	2.191	0.50	2.183	2.188	2.248	2.315	1.600	2.955	1.200
4Y	2.374	1.50	2.357	2.363	2.413	2.502	1.722	3.195	1.232
5Y	2.440	1.50	2.423	2.417	2.492	2.602	1.770	3.328	1.217
7Y	2.570	2.10	2.550	2.542	2.624	2.728	1.965	3.513	1.270
10Y	2.665	2.50	2.642	2.629	2.710	2.812	2.047	3.700	1.355
20Y	2.700	3.00	2.661	2.644	2.701	2.792	2.110	3.905	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.78	-0.04	107.76	107.78	107.70
LKTb	120.18	-0.24	120.12	120.19	119.89

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	-0.25	0.05	-0.53	-3.86	-3.99	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-6.35	-0.25	-6.34	-8.67	-9.52	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-10.20	0.55	-10.63	-12.00	-13.37	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-8.85	0.75	-9.43	-10.46	-11.26	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-21.40	0.00	-21.40	-22.08	-20.90	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.50	0.25	-23.72	-23.28	-24.06	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.25	-0.10	-32.25	-31.10	-31.90	-21.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-34.75	-0.50	-34.28	-33.21	-32.97	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-29.50	-1.00	-27.49	-26.04	-24.00	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1067.30 (+5.80)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-71.25	-3.75	1Y	1.1350	-3.00	1.6200	0.7650	1*2Y	11.50	-0.50
-74.25	-3.25	1.5Y	1.1950	-3.00	1.6600	0.9100	2*3Y	10.00	-1.50
-76.50	-4.75	2Y	1.2500	-3.50	1.6950	0.9050	2*5Y	22.50	-0.50
-75.25	-6.25	3Y	1.3500	-5.00	1.7550	0.9400	3*4Y	6.50	1.00
-74.50	-5.50	4Y	1.4150	-4.00	1.8000	0.9600	3*5Y	12.50	1.00
-73.00	-5.75	5Y	1.4750	-4.00	1.8500	0.9800	4*5Y	6.00	0.00
-63.25	-5.50	7Y	1.6150	-3.50	1.8950	1.0050	5*7Y	14.00	0.50
-49.75	-4.50	10Y	1.8200	-2.50	2.0500	1.0200	5*10Y	34.50	1.50

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	2.4657	0.0298	2.4359	2.4315	2.3941	2.4657	1.0420	2.4657	0.3000
10Y	2.9616	0.0494	2.9122	2.8668	2.8309	2.9616	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	34.87	2.28	32.59	32.15	29.21	34.87	-69.60	34.87	-251.80
10Y	29.66	2.44	27.22	22.48	19.89	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	30.25	0.75	29.50	29.75	30.00	42.50	19.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	54.80	1.80	53.00	53.20	53.00	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	49.59	1.96	47.63	43.53	43.68	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	73.5								
09M	79 / 79.75								
01Y	84.75 / 85.25								
1.5Y									
02Y					SPRD	2*3Y 9.25			
03Y	11								
04Y									
05Y	20.5 / 22.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	84 건	19	65	74	89	54	124	104	
금 액	28,240 억원	10,300	17,940	21,140	25,050	12,760	36,215	51,561	

장중동향
국고채 금리, 미 국채금리 상승과 외인의 국채선물 매도에 약세 흐름이 이어지면서 금리 상승.

IRS, 금리 상승 마감. 커브 스티프닝.
증권이 3년 국채선물을 매수하면서 선방한 모습. 금리는 올랐지만 상대적으로 오피리시 했던 분위기.

CRS, 애셋스왑 영향을 받으며 금리 하락.
수급상으로 애셋 롤오버 물량이 월말 앞두고 미리 나오는 모습.