IPS Daily Morning Brief

2018-04-13

종가 기준일 2018-04-12

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7300	3.50	1.7060	1.7100	1.7077	1.7400	1.3875	2.6700	1.2875
9M	1.7800	2.25	1.7640	1.7696	1.7722	1.8125	1.3675	2.7000	1.2500
1Y	1.8275	1.00	1.8145	1.8258	1.8360	1.8850	1.3625	2.7375	1.2200
1.5Y	1.9125	0.50	1.9045	1.9263	1.9475	2.0050	1.3625	2.8100	1.1900
2Y	1.9675	0.25	1.9645	2.0001	2.0308	2.1000	1.3650	2.8850	1.1675
3Y	2.0475	0.00	2.0490	2.1011	2.1390	2.2175	1.3925	3.0275	1.1550
4Y	2.0950	0.00	2.1020	2.1648	2.2083	2.2950	1.4275	3.1450	1.1575
5Y	2.1325	-0.25	2.1440	2.2075	2.2554	2.3400	1.4625	3.2400	1.1575
7Y	2.1725	-0.50	2.1910	2.2560	2.3094	2.3950	1.5225	3.3800	1.1675
10Y	2.2425	-0.50	2.2600	2.3214	2.3840	2.4850	1.6125	3.5250	1.2125
12Y	2.2875	-0.50	2.3050	2.3664	2.4252	2.5225	1.6250	3.5600	1.2150
15Y	2.3075	-0.50	2.3250	2.3864	2.4434	2.5400	1.6250	3.5825	1.2150
20Y	2.3300	-0.50	2.3475	2.4064	2.4627	2.5600	1.6000	3.7325	1.2150

6*9M	5.00	-1.25	5.80	5.96	6.45	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	4.75	-1.25	5.05	5.61	6.39	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	14.00	-0.75	15.00	17.44	19.47	23.00	0.25	23.00	-5.50
2*3Y	8.00	-0.25	8.45	10.10	10.83	13.25	2.75	14.25	-1.75
2*4Y	12.75	-0.25	13.75	16.46	17.76	21.75	6.25	27.75	-1.75
2*5Y	16.50	-0.50	17.95	20.74	22.47	27.25	9.75	38.50	-1.75
3*4Y	4.75	0.00	5.30	6.36	6.93	8.50	2.75	14.00	-0.50
3*5Y	8.50	-0.25	9.50	10.64	11.64	14.00	5.25	25.00	-0.50
4*5Y	3.75	-0.25	4.20	4.27	4.71	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.00	-0.25	4.70	4.85	5.40	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.00	-0.25	11.60	11.39	12.85	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.00	6.90	6.54	7.45	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	5.95	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.50	7.88	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.846	-0.50	1.850	1.887	1.873	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.005	-0.30	2.003	2.025	2.041	2.108	1.441	2.820	1.232
2Y	2.077	-0.50	2.090	2.131	2.164	2.230	1.457	2.895	1.225
3Y	2.150	-0.70	2.164	2.214	2.250	2.315	1.470	3.015	1.200
4Y	2.312	-0.80	2.326	2.393	2.415	2.502	1.590	3.275	1.232
5Y	2.375	-1.00	2.391	2.438	2.497	2.602	1.600	3.410	1.217
7Y	2.497	-0.60	2.512	2.564	2.629	2.728	1.736	3.563	1.270
10Y	2.577	-0.50	2.596	2.650	2.712	2.812	1.835	3.750	1.355
20Y	2.586	-2.10	2.612	2.655	2.694	2.792	1.945	3.935	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.96	0.04	107.95	107.99	107.88
LKTB	121.05	0.11	121.04	121.15	120.84

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	-1.85	1.50	-3.55	-6.15	-3.74	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-9.25	0.80	-9.89	-9.92	-9.36	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-10.95	0.75	-12.57	-13.06	-13.34	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-10.25	0.70	-11.48	-11.26	-11.13	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-21.70	0.80	-22.44	-22.82	-20.68	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-24.25	0.75	-24.68	-23.06	-24.16	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.45	0.10	-32.14	-30.75	-31.94	-21.35	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.45	0.00	-33.56	-32.81	-32.79	-22.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-25.60	1.60	-26.45	-24.85	-23.11	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-72.25	-0.50
-72.75	0.00
-69.75	0.25
-64.75	0.00
-63.00	0.00
-60.25	0.25
-51.75	0.00
-40.75	0.00

CRS

USD/KRW 1069.50 (+3.20)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1050	0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	16.50	0.00
1.5Y	1.1850	0.50	1.6600	0.9100	2*3Y	13.00	-0.50
2Y	1.2700	0.50	1.6950	0.9050	2*5Y	26.00	-0.50
3Y	1.4000	0.00	1.7550	0.9150	3*4Y	6.50	0.00
4Y	1.4650	0.00	1.8000	0.9200	3*5Y	13.00	0.00
5Y	1.5300	0.00	1.8500	0.9200	4*5Y	6.50	0.00
7Y	1.6550	-0.50	1.8950	0.9050	5*7Y	12.50	-0.50
10Y	1.8350	-0.50	2.0500	0.9150	5*10Y	30.50	-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	2.3522	0.0411	2.3111	2.3111	2.2825	2.3522	0.8980	2.3522	0.2900
10Y	2.8400	0.0571	2.7829	2.8030	2.7801	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	27.52	4.61	22.91	20.61	18.55	27.52	-70.50	27.52	-260.50
10Y	26.30	6.21	20.09	19.60	17.01	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	27.50	-0.75	28.25	30.25	30.75	42.50	19.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	50.00	0.00	50.00	50.20	51.30	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	48.78	1.60	47.18	49.19	49.76	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	74	ODD Tenor	
09M	77 / 77.5 / 78		
01Y	83.25 / 83.5		
1.5Y	91 / 91.25		
02Y		SPRD	7*10Y 07
03Y	4.25 / 4.75 / 6.25		
04Y			
05Y	14.75		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1Y CCS 10.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	104 건	-13	117	61	49	97	111	87
금 액	51,561 억원	14,344	37,217	13,088	18,107	26,635	28,915	34,930

장중동향

국고채 금리, 단기보다 장기물 금리가 더 하락하며 커브 플래트닝.
기준금리 1.50% 만장일치 동결 소식과 물가 전망치 하향에 국채선물 상승폭 증가.

IRS, 단기구간 금리 상승 & 장기구간 금리 하락하며 커브 플래트닝.
단기구간을 중심으로 비드가 강하게 올라오며 금리 상승.

CRS도 단기구간 금리 상승 & 장기구간 금리 하락.