IPS Daily Morning Brief

2018-04-17

종가 기준일 2018-04-16

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7250	0.00	1.7155	1.7106	1.7092	1.7400	1.3900	2.6700	1.2875
9M	1.7800	0.25	1.7715	1.7698	1.7733	1.8125	1.4075	2.6925	1.2500
1Y	1.8350	0.25	1.8250	1.8253	1.8363	1.8850	1.4175	2.7225	1.2200
1.5Y	1.9250	0.50	1.9140	1.9231	1.9469	2.0050	1.4400	2.7875	1.1900
2Y	1.9875	1.00	1.9730	1.9943	2.0297	2.1000	1.4700	2.8550	1.1675
3Y	2.0775	1.25	2.0590	2.0933	2.1376	2.2175	1.5050	2.9925	1.1550
4Y	2.1275	1.25	2.1085	2.1548	2.2065	2.2950	1.5625	3.1125	1.1575
5Y	2.1700	1.50	2.1490	2.1969	2.2536	2.3400	1.6050	3.2125	1.1575
7Y	2.2125	1.50	2.1920	2.2449	2.3076	2.3950	1.6750	3.3550	1.1675
10Y	2.2850	1.50	2.2630	2.3100	2.3824	2.4850	1.7700	3.4975	1.2125
12Y	2.3300	1.50	2.3080	2.3550	2.4238	2.5225	1.7775	3.5375	1.2150
15Y	2.3500	1.50	2.3280	2.3750	2.4421	2.5400	1.7775	3.5550	1.2150
20Y	2.3725	1.50	2.3505	2.3953	2.4616	2.5600	1.7000	3.7050	1.2150
6*9M	5.50	0.25	5.60	5.91	6.41	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	5.50	0.00	5.35	5.55	6.30	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	15.25	0.75	14.80	16.90	19.33	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	9.00	0.25	8.60	9.90	10.80	13.25	3.00	14.00	-1.75
2*4Y	14.00	0.25	13.55	16.05	17.68	21.75	7.00	27.75	-1.75
2*5Y	18.25	0.50	17.60	20.26	22.39	27.25	9.75	38.50	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	4.95	6.15	6.89	8.50	2.75	14.00	-0.50
3*5Y	9.25	0.25	9.00	10.36	11.60	14.00	5.25	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.25	4.05	4.21	4.71	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.25	0.00	4.30	4.80	5.40	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.50	0.00	11.40	11.31	12.88	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.25	0.00	7.10	6.51	7.48	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	5.97	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.53	7.92	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.841	0.50	1.846	1.878	1.874	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	1.990	-0.20	2.001	2.018	2.041	2.108	1.517	2.820	1.232
2Y	2.095	1.80	2.087	2.120	2.163	2.230	1.560	2.885	1.225
3Y	2.170	1.50	2.162	2.203	2.249	2.315	1.600	3.005	1.200
4Y	2.338	1.70	2.326	2.380	2.414	2.502	1.722	3.245	1.232
5Y	2.407	2.20	2.391	2.428	2.495	2.602	1.770	3.365	1.217
7Y	2.536	2.00	2.515	2.553	2.627	2.728	1.951	3.535	1.270
10Y	2.630	2.30	2.601	2.639	2.711	2.812	2.047	3.715	1.355
20Y	2.635	3.00	2.611	2.647	2.694	2.792	2.110	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	107.86	-0.06	107.90	107.83	107.86
LKTB	120.52	-0.19	120.60	120.69	120.52

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	-0.60	-0.25	-2.08	-5.31	-3.80	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-6.50	0.70	-8.70	-9.45	-9.40	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-10.75	-0.80	-11.42	-12.59	-13.38	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-9.25	-0.25	-10.34	-10.95	-11.18	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-21.05	-0.45	-21.73	-22.53	-20.76	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.70	-0.70	-24.24	-23.10	-24.15	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.35	-0.50	-32.34	-30.82	-31.92	-21.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-34.50	-0.80	-33.76	-32.94	-32.85	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.25	-1.50	-26.01	-25.22	-23.28	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-73.00	-0.25
-75.00	-0.50
-73.75	-1.00
-69.75	-1.25
-68.75	-1.25
-67.50	-1.50
-59.25	-1.50
-48.50	-1.50

CRS

USD/KRW 1074.00 (+4.50)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1050	0.00	1.6200	0.7650	1*2Y	14.50	0.00
1.5Y	1.1750	0.00	1.6600	0.9100	2*3Y	13.00	0.00
2Y	1.2500	0.00	1.6950	0.9050	2*5Y	24.50	0.00
3Y	1.3800	0.00	1.7550	0.9400	3*4Y	6.00	0.00
4Y	1.4400	0.00	1.8000	0.9600	3*5Y	11.50	0.00
5Y	1.4950	0.00	1.8500	0.9800	4*5Y	5.50	0.00
7Y	1.6200	0.00	1.8950	1.0050	5*7Y	12.50	0.00
10Y	1.8000	0.00	2.0500	1.0150	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	2.3774	0.0290	2.3484	2.3522	2.3111	2.3774	0.9200	2.3774	0.3000
10Y	2.8290	0.0028	2.8262	2.8400	2.7829	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	28.24	1.1	27.14	27.52	22.91	28.24	-70.50	28.24	-258.50
10Y	19.90	-2.02	21.92	26.30	20.09	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	29.75	0.50	29.25	27.50	28.25	42.50	19.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	53.50	0.50	53.00	50.00	50.00	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	45.16	-2.62	47.78	48.78	47.18	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	78	ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	98 / 98.25 / 98.5 / 98.75	SPRD	2*5y 18
03Y			2*10y 29.25
04Y			5*7y 4.25
05Y	16		7*15y 13.75
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	54 건	-70	124	104	117	61	49	97
금 액	12,760 억원	-23,455	36,215	51,561	37,217	13,088	18,107	26,635

장중동향

국고채 금리상승. 시리아 사태에 따른 안전자산선호, 외국인의 순매수 등 강세 재료가 있었지만 레벨부담으로 약세.

IRS는 전체적으로 조용한 가운데 거래가 적고 한산. 장 후반 국채선물이 급격히 약해지면서 레벨이 상승하면서 거래가 이뤄짐. 커브 스팁마감.

CRS는 변동없이 마감.