IPS Daily Morning Brief

2018-04-26

종가 기준일 2018-04-25

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7450	0.25	1.7390	1.7186	1.7133	1.7450	1.3900	2.6700	1.2875
9M	1.8075	1.00	1.7960	1.7760	1.7757	1.8125	1.4100	2.6925	1.2500
1Y	1.8775	1.50	1.8585	1.8311	1.8366	1.8850	1.4350	2.7225	1.2200
1.5Y	1.9750	2.00	1.9530	1.9258	1.9444	2.0050	1.4625	2.7875	1.1900
2Y	2.0575	2.25	2.0300	1.9935	2.0259	2.1000	1.4700	2.8525	1.1675
3Y	2.1650	3.00	2.1265	2.0865	2.1328	2.2175	1.5050	2.9825	1.1550
4Y	2.2400	3.75	2.1905	2.1456	2.2011	2.2950	1.5625	3.1075	1.1575
5Y	2.2875	4.00	2.2355	2.1880	2.2484	2.3400	1.6125	3.2125	1.1575
7Y	2.3375	4.25	2.2810	2.2343	2.3018	2.3950	1.6825	3.3550	1.1675
10Y	2.4075	4.25	2.3510	2.3015	2.3772	2.4850	1.7700	3.4975	1.2125
12Y	2.4525	4.25	2.3960	2.3465	2.4195	2.5225	1.7775	3.5375	1.2150
15Y	2.4725	4.25	2.4160	2.3665	2.4385	2.5400	1.7775	3.5550	1.2150
20Y	2.4950	4.25	2.4385	2.3890	2.4585	2.5600	1.7000	3.7050	1.2150
6*9M	6.25	0.75	5.70	5.74	6.25	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	7.00	0.50	6.25	5.51	6.09	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	18.00	0.75	17.15	16.24	18.93	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.75	0.75	9.65	9.30	10.69	13.25	3.00	13.75	-1.75
2*4Y	18.25	1.50	16.05	15.21	17.52	21.75	7.00	27.75	-1.75
2*5Y	23.00	1.75	20.55	19.45	22.25	27.25	9.75	38.50	-1.75
3*4Y	7.50	0.75	6.40	5.91	6.83	8.50	2.75	14.00	-0.50
3*5Y	12.25	1.00	10.90	10.15	11.56	14.00	5.25	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	0.25	4.50	4.24	4.73	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	5.00	0.25	4.55	4.63	5.33	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	12.00	0.25	11.55	11.35	12.88	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.00	7.00	6.73	7.55	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.50	4.23	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.50	6.13	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.75	8.13	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.864	1.10	1.854	1.858	1.877	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.026	1.10	2.011	2.006	2.040	2.108	1.517	2.775	1.232
2Y	2.156	2.10	2.132	2.109	2.158	2.230	1.560	2.840	1.225
3Y	2.247	2.70	2.215	2.188	2.245	2.315	1.600	2.930	1.200
4Y	2.435	2.80	2.398	2.363	2.410	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.525	3.60	2.474	2.424	2.488	2.602	1.770	3.320	1.217
7Y	2.660	4.00	2.605	2.550	2.621	2.728	1.965	3.510	1.270
10Y	2.767	4.70	2.703	2.639	2.708	2.812	2.047	3.700	1.355
20Y	2.755	2.30	2.720	2.656	2.702	2.792	2.110	3.905	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.50	5.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.58	-0.09	107.67	107.68	107.58
LKTB	119.20	-0.46	119.60	119.60	119.20

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	1.35	0.40	0.45	-2.73	-4.03	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-5.10	0.90	-5.80	-8.06	-9.54	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-9.85	0.15	-10.20	-11.59	-13.24	-1.35	-25.00	5.50	-25.15
3Y	-8.20	0.30	-8.85	-10.18	-11.25	4.75	-19.40	8.75	-19.50
4Y	-19.50	0.95	-20.79	-21.69	-20.92	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.75	0.40	-23.89	-23.61	-23.97	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.25	0.25	-32.38	-31.56	-31.88	-21.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-35.95	-0.45	-35.18	-33.76	-33.09	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.00	1.95	-28.17	-26.75	-24.37	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-74.25	-2.00
-80.50	-4.50
-83.25	-4.75
-84.50	-5.50
-86.00	-6.75
-84.75	-7.00
-74.75	-6.25
-59.75	-4.75

CRS

USD/KRW 1080.60 (+3.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1350	-0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	9.00	-2.00
1.5Y	1.1700	-2.50	1.6600	0.8250	2*3Y	9.50	0.00
2Y	1.2250	-2.50	1.6950	0.8750	2*5Y	21.50	-0.50
3Y	1.3200	-2.50	1.7550	0.9550	3*4Y	6.00	-0.50
4Y	1.3800	-3.00	1.8000	1.0150	3*5Y	12.00	-0.50
5Y	1.4400	-3.00	1.8500	1.0350	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.5900	-2.00	1.8950	1.0400	5*7Y	15.00	1.00
10Y	1.8100	-0.50	2.0500	1.0500	5*10Y	37.00	2.50

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	2.4913	0.0208	2.4705	2.4743	2.4657	2.4913	1.0910	2.4913	0.3000
10Y	3.0282	0.0254	3.0028	2.9757	2.9616	3.0282	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	33.53	-0.02	33.55	33.23	34.87	34.87	-69.60	34.87	-251.80
10Y	26.12	-2.16	28.28	25.37	29.66	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	35.00	2.00	33.00	32.75	30.25	42.50	19.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	61.10	2.60	58.50	58.00	54.80	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	53.69	0.46	53.23	50.14	49.59	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	74.5	ODD Tenor	
09M	80.25 / 80.5		
01Y	87 / 87.75		
1.5Y	97.75		
02Y	5.75 / 06	SPRD	6*12M 13.25
03Y	16		1*2Y 17.5
04Y	23		1*4Y 36.25
05Y	27.75		1*5Y 40
07Y			1.5*2Y 8.25
10Y	39.5		2*5Y 22.5
12Y			5*10Y 12
15Y			6*10Y 09
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	139 건	42	97	97	84	65	74	89
금 액	44,243 억원	18,288	25,955	27,425	28,240	17,940	21,140	25,050

장중동향

국고채 금리, 미 금리 3% 돌파에 따른 부담감과 외인의 국채선물 순매도로 국고채 금리 상승.

IRS, 국채선물이 밀림에 따라 금리 상승. 커브 스티프닝.
특히 1년 금리가 높은 수준인데도 비드가 강하게 올라오며 금리 상승.

CRS, 금리 하락 마감.