IPS Daily Morning Brief

2018-04-27

종가 기준일 2018-04-26

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7325	-1.25	1.7400	1.7196	1.7139	1.7450	1.3900	2.6700	1.2875
9M	1.7950	-1.25	1.7980	1.7771	1.7764	1.8125	1.4100	2.6925	1.2500
1Y	1.8625	-1.50	1.8630	1.8328	1.8372	1.8850	1.4350	2.7225	1.2200
1.5Y	1.9575	-1.75	1.9575	1.9269	1.9445	2.0050	1.4625	2.7875	1.1900
2Y	2.0350	-2.25	2.0365	1.9949	2.0258	2.1000	1.4700	2.8525	1.1675
3Y	2.1425	-2.25	2.1370	2.0881	2.1325	2.2175	1.5050	2.9825	1.1550
4Y	2.2175	-2.25	2.2050	2.1479	2.2006	2.2950	1.5625	3.1075	1.1575
5Y	2.2675	-2.00	2.2515	2.1908	2.2479	2.3400	1.6125	3.2125	1.1575
7Y	2.3175	-2.00	2.2990	2.2371	2.3011	2.3950	1.6825	3.3550	1.1675
10Y	2.3875	-2.00	2.3690	2.3049	2.3766	2.4850	1.7700	3.4975	1.2125
12Y	2.4325	-2.00	2.4140	2.3499	2.4190	2.5225	1.7775	3.5375	1.2150
15Y	2.4525	-2.00	2.4340	2.3699	2.4380	2.5400	1.7775	3.5550	1.2150
20Y	2.4750	-2.00	2.4565	2.3924	2.4582	2.5600	1.7000	3.7050	1.2150

6*9M	6.25	0.00	5.80	5.75	6.25	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	6.75	-0.25	6.50	5.56	6.08	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	17.25	-0.75	17.35	16.21	18.86	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.75	0.00	10.05	9.32	10.67	13.25	3.00	13.75	-1.75
2*4Y	18.25	0.00	16.85	15.30	17.48	21.75	7.00	27.75	-1.75
2*5Y	23.25	0.25	21.50	19.59	22.21	27.25	9.75	38.50	-1.75
3*4Y	7.50	0.00	6.80	5.98	6.81	8.50	2.75	14.00	-0.50
3*5Y	12.50	0.25	11.45	10.26	11.54	14.00	5.25	25.00	-0.50
4*5Y	5.00	0.25	4.65	4.29	4.73	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	5.00	0.00	4.75	4.64	5.32	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	12.00	0.00	11.75	11.41	12.87	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.00	7.00	6.78	7.55	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.50	4.24	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.50	6.15	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.75	8.16	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.856	-0.80	1.857	1.856	1.877	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.018	-0.80	2.015	2.006	2.040	2.108	1.517	2.775	1.232
2Y	2.135	-2.10	2.137	2.109	2.158	2.230	1.560	2.840	1.225
3Y	2.222	-2.50	2.222	2.188	2.245	2.315	1.600	2.930	1.200
4Y	2.410	-2.50	2.409	2.363	2.410	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.500	-2.50	2.489	2.427	2.487	2.602	1.770	3.320	1.217
7Y	2.634	-2.60	2.622	2.554	2.620	2.728	1.965	3.510	1.270
10Y	2.740	-2.70	2.723	2.644	2.708	2.812	2.047	3.700	1.355
20Y	2.740	-1.50	2.734	2.662	2.703	2.792	2.110	3.905	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.66	0.08	107.59	107.66	107.58
LKTB	119.44	0.24	119.19	119.44	119.17

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	0.65	-0.70	0.64	-2.34	-3.99	9.00	-16.60	11.00	-17.75
1.5Y	-6.05	-0.95	-5.79	-7.88	-9.52	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-10.00	-0.15	-10.05	-11.44	-13.18	-1.35	-23.25	5.50	-25.15
3Y	-7.95	0.25	-8.52	-10.02	-11.23	4.75	-18.50	8.75	-19.50
4Y	-19.25	0.25	-20.36	-21.50	-20.91	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.25	0.50	-23.79	-23.66	-23.94	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.65	0.60	-32.28	-31.66	-31.87	-21.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-35.25	0.70	-35.38	-33.94	-33.12	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.50	-0.50	-27.77	-26.95	-24.48	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-70.25	4.00
-76.75	3.75
-79.50	3.75
-81.25	3.25
-82.75	3.25
-81.75	3.00
-71.75	3.00
-56.75	3.00

CRS

USD/KRW 1080.00 (-0.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1600	2.50	1.6200	0.7650	1*2Y	8.00	-1.00
1.5Y	1.1900	2.00	1.6600	0.8100	2*3Y	9.00	-0.50
2Y	1.2400	1.50	1.6950	0.8650	2*5Y	21.00	-0.50
3Y	1.3300	1.00	1.7550	0.9550	3*4Y	6.00	0.00
4Y	1.3900	1.00	1.8000	1.0150	3*5Y	12.00	0.00
5Y	1.4500	1.00	1.8500	1.0350	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.6000	1.00	1.8950	1.0400	5*7Y	15.00	0.00
10Y	1.8200	1.00	2.0500	1.0500	5*10Y	37.00	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	2.4834	-0.0079	2.4913	2.4705	2.4743	2.4913	1.0910	2.4913	0.3000
10Y	2.9833	-0.0449	3.0282	3.0028	2.9757	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	34.84	1.31	33.53	33.55	33.23	34.87	-69.60	34.87	-251.80
10Y	24.33	-1.79	26.12	28.28	25.37	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	35.25	0.25	35.00	33.00	32.75	42.50	19.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	60.50	-0.60	61.10	58.50	58.00	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	49.99	-3.70	53.69	53.23	50.14	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	87.5 / 87		
1.5Y	96.5 / 95.75		
02Y	4.75	SPRD	2*5Y 22.75
03Y	15		
04Y	22.5 / 22.25 / 22		
05Y	27.5		
07Y	32.75		
10Y			
12Y			
15Y	46.25		
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	88 건	-51	139	97	97	84	65	74
금 액	25,285 억원	-18,958	44,243	25,955	27,425	28,240	17,940	21,140

장중동향

국고채 금리, 대부분 구간에서 하락.
아시아장에서 미국 10년물 금리가 내림세를 보인 영향과 ECB가 통화정책회의에서 비둘기 기조를 보일 것이란 전망에 국채선물은 강세를 나타냄.

IRS, 하락.
아시아시장에서 미 금리 하락에 연동. 자중 2*4년과 2*5년이 래깅으로 거래되는 모습.

CRS, FX 스왑의 영향을 받아 상승.