IPS Daily Morning Brief

2018-04-19

종가 기준일 2018-04-18

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7275	0.25	1.7265	1.7114	1.7105	1.7400	1.3900	2.6700	1.2875
9M	1.7850	0.50	1.7805	1.7698	1.7743	1.8125	1.4075	2.6925	1.2500
1Y	1.8400	0.50	1.8340	1.8241	1.8365	1.8850	1.4175	2.7225	1.2200
1.5Y	1.9350	0.75	1.9240	1.9205	1.9465	2.0050	1.4400	2.7875	1.1900
2Y	2.0025	0.75	1.9860	1.9896	2.0290	2.1000	1.4700	2.8550	1.1675
3Y	2.0900	0.75	2.0725	2.0860	2.1366	2.2175	1.5050	2.9900	1.1550
4Y	2.1450	0.75	2.1240	2.1460	2.2053	2.2950	1.5625	3.1100	1.1575
5Y	2.1875	0.75	2.1650	2.1878	2.2525	2.3400	1.6050	3.2125	1.1575
7Y	2.2275	0.50	2.2065	2.2350	2.3064	2.3950	1.6750	3.3550	1.1675
10Y	2.3000	0.50	2.2785	2.3004	2.3816	2.4850	1.7700	3.4975	1.2125
12Y	2.3450	0.50	2.3235	2.3454	2.4230	2.5225	1.7775	3.5375	1.2150
15Y	2.3650	0.50	2.3435	2.3654	2.4415	2.5400	1.7775	3.5550	1.2150
20Y	2.3875	0.50	2.3660	2.3874	2.4612	2.5600	1.7000	3.7050	1.2150

6*9M	5.75	0.25	5.40	5.84	6.38	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	5.50	0.00	5.35	5.44	6.23	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	16.25	0.25	15.20	16.55	19.25	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	8.75	0.00	8.65	9.64	10.76	13.25	3.00	13.75	-1.75
2*4Y	14.25	0.00	13.80	15.64	17.63	21.75	7.00	27.75	-1.75
2*5Y	18.50	0.00	17.90	19.81	22.35	27.25	9.75	38.50	-1.75
3*4Y	5.50	0.00	5.15	6.00	6.87	8.50	2.75	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	0.00	9.25	10.18	11.59	14.00	5.25	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.00	4.10	4.17	4.72	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.00	-0.25	4.15	4.73	5.39	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.25	-0.25	11.35	11.26	12.91	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.25	0.00	7.20	6.54	7.52	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.50	4.14	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.50	6.00	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.70	7.96	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.845	0.00	1.843	1.870	1.875	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	1.996	0.20	1.995	2.010	2.041	2.108	1.517	2.820	1.232
2Y	2.110	0.80	2.092	2.112	2.163	2.230	1.560	2.885	1.225
3Y	2.190	1.30	2.168	2.192	2.249	2.315	1.600	3.005	1.200
4Y	2.362	1.00	2.337	2.369	2.414	2.502	1.722	3.245	1.232
5Y	2.427	1.00	2.402	2.419	2.494	2.602	1.770	3.365	1.217
7Y	2.552	0.90	2.529	2.544	2.626	2.728	1.956	3.535	1.270
10Y	2.642	1.00	2.618	2.630	2.711	2.812	2.047	3.715	1.355
20Y	2.657	1.20	2.626	2.643	2.697	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	107.81	-0.03	107.86	107.90	107.78
LKTB	120.42	-0.07	120.60	120.67	120.26

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	-0.50	0.50	-0.86	-4.59	-3.88	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-6.10	0.55	-7.14	-8.99	-9.44	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-10.75	-0.05	-10.62	-12.20	-13.39	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-10.00	-0.55	-9.59	-10.65	-11.25	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-21.70	-0.25	-21.30	-22.25	-20.87	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.95	-0.25	-23.72	-23.13	-24.14	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.45	-0.40	-32.23	-30.90	-31.92	-21.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-34.20	-0.50	-33.91	-33.00	-32.90	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.95	-0.70	-25.96	-25.52	-23.61	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-69.00	3.00
-72.00	2.25
-71.75	1.75
-68.00	1.25
-67.50	0.75
-65.75	0.75
-56.75	1.00
-44.50	1.50

CRS

USD/KRW 1068.70 (+1.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1500	3.50	1.6200	0.7650	1*2Y	13.50	-1.00
1.5Y	1.2150	3.00	1.6600	0.9100	2*3Y	12.50	-0.50
2Y	1.2850	2.50	1.6950	0.9050	2*5Y	24.50	-1.00
3Y	1.4100	2.00	1.7550	0.9400	3*4Y	6.00	-0.50
4Y	1.4700	1.50	1.8000	0.9600	3*5Y	12.00	-0.50
5Y	1.5300	1.50	1.8500	0.9800	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.6600	1.50	1.8950	1.0050	5*7Y	13.00	0.00
10Y	1.8550	2.00	2.0500	1.0150	5*10Y	32.50	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	2.4315	0.0374	2.3941	2.3774	2.3484	2.4315	1.0000	2.4315	0.3000
10Y	2.8668	0.0359	2.8309	2.8290	2.8262	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	32.15	2.94	29.21	28.24	27.14	32.15	-69.90	32.15	-258.50
10Y	22.48	2.59	19.89	19.90	21.92	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	-0.25	30.00	29.75	29.25	42.50	19.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	53.20	0.20	53.00	53.50	53.00	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	43.53	-0.15	43.68	45.16	47.78	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	78		
01Y	83 / 83.25 / 83.5 / 84		
1.5Y	92.75		
02Y	99 / 99.25 / 99.5	SPRD	6*9M 06
03Y	7.75		
04Y	14.75		
05Y	17.75 / 17.25		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	74 건	-15	89	54	124	104	117	61
금 액	21,140 억원	-3,910	25,050	12,760	36,215	51,561	37,217	13,088

장중동향

국고채 금리, 상승.
국채선물은 상승 출발했지만, 오후들어 트럼프 미국 대통령의 종전협상 발언이 전해지면서 국채선물 약세전환.

IRS 금리, 소폭 상승.
국채선물 따라 연동되는 모습. 장중 강세를 유지하다 막판 선물이 빠짐에 따라 IRS도 약세.

CRS 금리, 상승 마감.
부채 스와프가 있을 거라는 소문에 비드 수요가 많음.