IPS Daily Morning Brief

2018-04-25

종가 기준일 2018-04-24

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7425	-0.25	1.7355	1.7170	1.7125	1.7450	1.3900	2.6700	1.2875
9M	1.7975	-0.25	1.7915	1.7743	1.7751	1.8125	1.4100	2.6925	1.2500
1Y	1.8625	-0.25	1.8510	1.8288	1.8362	1.8850	1.4350	2.7225	1.2200
1.5Y	1.9550	-0.75	1.9450	1.9238	1.9443	2.0050	1.4625	2.7875	1.1900
2Y	2.0350	-0.50	2.0190	1.9911	2.0260	2.1000	1.4700	2.8525	1.1675
3Y	2.1350	-0.50	2.1115	2.0839	2.1331	2.2175	1.5050	2.9825	1.1550
4Y	2.2025	-0.25	2.1715	2.1424	2.2015	2.2950	1.5625	3.1075	1.1575
5Y	2.2475	-0.25	2.2155	2.1844	2.2488	2.3400	1.6125	3.2125	1.1575
7Y	2.2950	-0.25	2.2590	2.2305	2.3022	2.3950	1.6825	3.3550	1.1675
10Y	2.3650	-0.25	2.3295	2.2973	2.3777	2.4850	1.7700	3.4975	1.2125
12Y	2.4100	-0.25	2.3745	2.3423	2.4198	2.5225	1.7775	3.5375	1.2150
15Y	2.4300	-0.25	2.3945	2.3623	2.4388	2.5400	1.7775	3.5550	1.2150
20Y	2.4525	-0.25	2.4170	2.3848	2.4587	2.5600	1.7000	3.7050	1.2150

6*9M	5.50	0.00	5.60	5.73	6.26	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	6.50	0.00	5.95	5.45	6.10	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	17.25	-0.25	16.80	16.24	18.99	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.00	0.00	9.25	9.28	10.70	13.25	3.00	13.75	-1.75
2*4Y	16.75	0.25	15.25	15.13	17.54	21.75	7.00	27.75	-1.75
2*5Y	21.25	0.25	19.65	19.33	22.28	27.25	9.75	38.50	-1.75
3*4Y	6.75	0.25	6.00	5.85	6.84	8.50	2.75	14.00	-0.50
3*5Y	11.25	0.25	10.40	10.05	11.58	14.00	5.25	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.40	4.20	4.74	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	4.35	4.61	5.34	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.75	0.00	11.40	11.29	12.88	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.00	7.05	6.68	7.55	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.50	4.21	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.50	6.11	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.75	8.10	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.853	-0.70	1.850	1.860	1.877	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.015	-0.20	2.005	2.007	2.040	2.108	1.517	2.775	1.232
2Y	2.135	-0.70	2.123	2.108	2.159	2.230	1.560	2.840	1.225
3Y	2.220	-1.10	2.204	2.187	2.246	2.315	1.600	2.930	1.200
4Y	2.407	-1.00	2.384	2.361	2.411	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.489	-0.40	2.455	2.420	2.489	2.602	1.770	3.320	1.217
7Y	2.620	-0.50	2.583	2.545	2.621	2.728	1.965	3.510	1.270
10Y	2.720	-0.20	2.678	2.633	2.708	2.812	2.047	3.700	1.355
20Y	2.732	-1.20	2.701	2.650	2.702	2.792	2.110	3.905	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.67	0.04	107.64	107.71	107.64
LKTB	119.66	0.03	119.63	119.79	119.57

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	0.95	0.45	0.08	-3.14	-4.05	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-6.00	-0.55	-6.00	-8.29	-9.56	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-10.00	0.20	-10.38	-11.73	-13.29	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-8.50	0.60	-9.21	-10.31	-11.26	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-20.45	0.75	-21.23	-21.87	-20.92	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-24.15	0.15	-23.93	-23.53	-24.00	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.50	0.25	-32.42	-31.42	-31.88	-21.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-35.50	-0.05	-34.83	-33.56	-33.05	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-27.95	0.95	-28.36	-26.57	-24.29	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-72.25	2.25
-76.00	2.25
-78.50	2.00
-79.00	1.50
-79.25	1.25
-77.75	1.25
-68.50	1.25
-55.00	1.25

CRS

USD/KRW 1076.80 (+7.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1400	2.00	1.6200	0.7650	1*2Y	11.00	-0.50
1.5Y	1.1950	1.50	1.6600	0.8950	2*3Y	9.50	-0.50
2Y	1.2500	1.50	1.6950	0.9300	2*5Y	22.00	-0.50
3Y	1.3450	1.00	1.7550	0.9550	3*4Y	6.50	0.00
4Y	1.4100	1.00	1.8000	0.9850	3*5Y	12.50	0.00
5Y	1.4700	1.00	1.8500	1.0000	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.6100	1.00	1.8950	1.0250	5*7Y	14.00	0.00
10Y	1.8150	1.00	2.0500	1.0400	5*10Y	34.50	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	2.4705	-0.0038	2.4743	2.4657	2.4359	2.4743	1.0710	2.4743	0.3000
10Y	3.0028	0.0271	2.9757	2.9616	2.9122	3.0028	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	33.55	0.32	33.23	34.87	32.59	34.87	-69.60	34.87	-251.80
10Y	28.28	2.91	25.37	29.66	27.22	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	33.00	0.25	32.75	30.25	29.50	42.50	19.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	58.50	0.50	58.00	54.80	53.00	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	53.23	3.09	50.14	49.59	47.63	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	79.25		
01Y	85.75 / 86		
1.5Y			
02Y	2.75 / 03 / 3.25	SPRD	9*12m 6.5
03Y	13		1*2y 17
04Y			1*3y 27
05Y	24		3*4y 6.5
07Y			
10Y	35.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	97 건	0	97	84	65	74	89	54
금 액	25,955 억원	-1,470	27,425	28,240	17,940	21,140	25,050	12,760

장중동향

국고채 금리 소폭 하락. 미국채권 금리가 전일에도 상승했지만, 저가매수 유입으로 갸보합세를 유지. 오후한때 외인의 매도로 하락 전환하기도했지만 강보합 마감.

IRS도 전 구간 레벨 소폭 하락. 단기와 중기테너 거래가 활발했고, 10년 장기쪽도 간간히 거래. 역외로 추정되는 비드가 꾸준히 나와 오퍼 비드가 타이트하게 형성.

CRS는 전 구간에서 상승 마감.