IPS Daily Morning Brief

2018-04-18

종가 기준일 2018-04-17

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7250	0.00	1.7200	1.7108	1.7098	1.7400	1.3900	2.6700	1.2875
9M	1.7800	0.00	1.7750	1.7696	1.7738	1.8125	1.4075	2.6925	1.2500
1Y	1.8350	0.00	1.8295	1.8246	1.8364	1.8850	1.4175	2.7225	1.2200
1.5Y	1.9275	0.25	1.9185	1.9216	1.9467	2.0050	1.4400	2.7875	1.1900
2Y	1.9950	0.75	1.9785	1.9918	2.0293	2.1000	1.4700	2.8550	1.1675
3Y	2.0825	0.50	2.0640	2.0895	2.1371	2.2175	1.5050	2.9900	1.1550
4Y	2.1375	1.00	2.1140	2.1503	2.2059	2.2950	1.5625	3.1100	1.1575
5Y	2.1800	1.00	2.1545	2.1921	2.2530	2.3400	1.6050	3.2125	1.1575
7Y	2.2225	1.00	2.1965	2.2399	2.3070	2.3950	1.6750	3.3550	1.1675
10Y	2.2950	1.00	2.2680	2.3050	2.3820	2.4850	1.7700	3.4975	1.2125
12Y	2.3400	1.00	2.3130	2.3500	2.4233	2.5225	1.7775	3.5375	1.2150
15Y	2.3600	1.00	2.3330	2.3700	2.4418	2.5400	1.7775	3.5550	1.2150
20Y	2.3825	1.00	2.3555	2.3904	2.4613	2.5600	1.7000	3.7050	1.2150

6*9M	5.50	0.00	5.50	5.89	6.40	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	5.50	0.00	5.45	5.50	6.26	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	16.00	0.75	14.90	16.71	19.29	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	8.75	-0.25	8.55	9.78	10.78	13.25	3.00	13.75	-1.75
2*4Y	14.25	0.25	13.55	15.85	17.66	21.75	7.00	27.75	-1.75
2*5Y	18.50	0.25	17.60	20.04	22.37	27.25	9.75	38.50	-1.75
3*4Y	5.50	0.50	5.00	6.08	6.88	8.50	2.75	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	0.50	9.05	10.26	11.59	14.00	5.25	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.00	4.05	4.19	4.71	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.25	0.00	4.20	4.78	5.40	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.50	0.00	11.35	11.29	12.90	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.25	0.00	7.15	6.51	7.50	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	5.98	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.54	7.94	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	0.40	1.844	1.874	1.875	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	1.994	0.40	1.998	2.014	2.041	2.108	1.517	2.820	1.232
2Y	2.102	0.70	2.087	2.116	2.163	2.230	1.560	2.885	1.225
3Y	2.177	0.70	2.162	2.197	2.249	2.315	1.600	3.005	1.200
4Y	2.352	1.40	2.329	2.374	2.414	2.502	1.722	3.245	1.232
5Y	2.417	1.00	2.394	2.423	2.494	2.602	1.770	3.365	1.217
7Y	2.543	0.70	2.519	2.548	2.626	2.728	1.951	3.535	1.270
10Y	2.632	0.20	2.606	2.634	2.711	2.812	2.047	3.715	1.355
20Y	2.645	1.00	2.616	2.644	2.696	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	107.84	-0.02	107.88	107.89	107.82
LKTB	120.49	-0.03	120.59	120.62	120.41

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	-1.00	-0.40	-1.43	-4.95	-3.84	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-6.65	-0.15	-7.93	-9.22	-9.42	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-10.70	0.05	-10.81	-12.39	-13.38	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-9.45	-0.20	-9.78	-10.78	-11.22	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-21.45	-0.40	-21.46	-22.38	-20.82	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.70	0.00	-23.93	-23.10	-24.15	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.05	0.30	-32.25	-30.83	-31.92	-21.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.70	0.80	-33.76	-32.94	-32.87	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.25	0.00	-26.01	-25.41	-23.43	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-72.00	1.00
-74.25	0.75
-73.50	0.25
-69.25	0.50
-68.25	0.50
-66.50	1.00
-57.75	1.50
-46.00	2.50

CRS

USD/KRW 1067.00 (-7.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1150	1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	14.50	0.00
1.5Y	1.1850	1.00	1.6600	0.9100	2*3Y	13.00	0.00
2Y	1.2600	1.00	1.6950	0.9050	2*5Y	25.50	1.00
3Y	1.3900	1.00	1.7550	0.9400	3*4Y	6.50	0.50
4Y	1.4550	1.50	1.8000	0.9600	3*5Y	12.50	1.00
5Y	1.5150	2.00	1.8500	0.9800	4*5Y	6.00	0.50
7Y	1.6450	2.50	1.8950	1.0050	5*7Y	13.00	0.50
10Y	1.8350	3.50	2.0500	1.0150	5*10Y	32.00	1.50

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	2.3941	0.0167	2.3774	2.3484	2.3522	2.3941	1.0000	2.3941	0.3000
10Y	2.8309	0.0019	2.8290	2.8262	2.8400	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	29.21	0.97	28.24	27.14	27.52	29.21	-69.90	29.21	-258.50
10Y	19.89	-0.01	19.90	21.92	26.30	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	30.00	0.25	29.75	29.25	27.50	42.50	19.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	53.00	-0.50	53.50	53.00	50.00	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	43.68	-1.48	45.16	47.78	48.78	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	15M 88.5
06M			
09M			
01Y	83.5		
1.5Y	92.75		
02Y	99.25 / 99.5	SPRD	6*9M 5.5
03Y			9M*3Y 30.25
04Y			1*5Y 34 / 34.25
05Y	17		4*5Y 4.5
07Y	22.25		
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3Y CCS 38		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	89 건	35	54	124	104	117	61	49
금 액	25,050 억원	12,290	12,760	36,215	51,561	37,217	13,088	18,107

장중동향

국고채 금리, 특별한 이벤트가 없는 가운데 대부분 구간에서 금리 소폭 상승 마감.

IRS, 변동성이 제한 속 금리 상승. 전반적으로 조용한 분위기.
외인의 선물 매수에 영향을 받아 오퍼가 우위를 보였지만 비드도 간간이 출현.
오전동안 CCP 10건을 겨우 넘는 수준을 보이다 오후들어 차차 거래.

CRS, 환율 하락과 동시에 금리가 소폭 올라오는 모습.