

IPS Daily Morning Brief

2018-04-24

종가 기준일 2018-04-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7450	1.00	1.7320	1.7156	1.7121	1.7450	1.3900	2.6700	1.2875
9M	1.8000	1.00	1.7880	1.7731	1.7751	1.8125	1.4100	2.6925	1.2500
1Y	1.8650	1.75	1.8455	1.8274	1.8363	1.8850	1.4350	2.7225	1.2200
1.5Y	1.9625	2.50	1.9395	1.9229	1.9451	2.0050	1.4625	2.7875	1.1900
2Y	2.0400	2.50	2.0110	1.9904	2.0271	2.1000	1.4700	2.8525	1.1675
3Y	2.1400	3.75	2.1010	2.0838	2.1345	2.2175	1.5050	2.9825	1.1550
4Y	2.2050	4.50	2.1585	2.1423	2.2030	2.2950	1.5625	3.1075	1.1575
5Y	2.2500	4.50	2.2020	2.1840	2.2504	2.3400	1.6125	3.2125	1.1575
7Y	2.2975	5.00	2.2445	2.2304	2.3038	2.3950	1.6825	3.3550	1.1675
10Y	2.3675	5.00	2.3155	2.2968	2.3793	2.4850	1.7700	3.4975	1.2125
12Y	2.4125	5.00	2.3605	2.3418	2.4212	2.5225	1.7775	3.5375	1.2150
15Y	2.4325	5.00	2.3805	2.3618	2.4400	2.5400	1.7775	3.5550	1.2150
20Y	2.4550	5.00	2.4030	2.3841	2.4599	2.5600	1.7000	3.7050	1.2150

6*9M	5.50	0.00	5.60	5.75	6.30	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	6.50	0.75	5.75	5.43	6.13	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	17.50	0.75	16.55	16.30	19.08	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.00	1.25	9.00	9.34	10.73	13.25	3.00	13.75	-1.75
2*4Y	16.50	2.00	14.75	15.19	17.59	21.75	7.00	27.75	-1.75
2*5Y	21.00	2.00	19.10	19.36	22.33	27.25	9.75	38.50	-1.75
3*4Y	6.50	0.75	5.75	5.85	6.85	8.50	2.75	14.00	-0.50
3*5Y	11.00	0.75	10.10	10.03	11.59	14.00	5.25	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.35	4.17	4.74	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	0.50	4.25	4.64	5.35	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.75	0.50	11.35	11.28	12.89	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.00	7.10	6.64	7.54	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.50	4.19	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.50	6.08	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.74	8.07	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.860	1.00	1.849	1.862	1.877	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.017	1.60	2.001	2.007	2.041	2.108	1.517	2.775	1.232
2Y	2.142	2.50	2.116	2.109	2.161	2.230	1.560	2.840	1.225
3Y	2.231	4.00	2.195	2.187	2.247	2.315	1.600	2.930	1.200
4Y	2.417	4.30	2.373	2.362	2.412	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.493	5.30	2.440	2.418	2.491	2.602	1.770	3.320	1.217
7Y	2.625	5.50	2.568	2.543	2.623	2.728	1.965	3.510	1.270
10Y	2.722	5.70	2.660	2.630	2.710	2.812	2.047	3.700	1.355
20Y	2.744	4.40	2.683	2.647	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	107.63	-0.15	107.70	107.72	107.61
LKTb	119.63	-0.55	119.80	119.86	119.57

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.50	0.75	-0.31	-3.51	-4.03	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-5.45	0.90	-6.13	-8.45	-9.54	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-10.20	0.00	-10.52	-11.84	-13.34	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-9.10	-0.25	-9.40	-10.35	-11.27	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-21.20	0.20	-21.43	-21.96	-20.92	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-24.30	-0.80	-23.84	-23.41	-24.03	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.75	-0.50	-32.33	-31.25	-31.90	-21.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-35.45	-0.70	-34.47	-33.36	-33.03	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-28.90	0.60	-28.02	-26.28	-24.22	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1069.00 (+1.70)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-74.50	-3.25	1Y	1.1200	-1.50	1.6200	0.7650	1*2Y	11.50	0.00
-78.25	-4.00	1.5Y	1.1800	-1.50	1.6600	0.8950	2*3Y	10.00	0.00
-80.50	-4.00	2Y	1.2350	-1.50	1.6950	0.9050	2*5Y	22.50	0.00
-80.50	-5.25	3Y	1.3350	-1.50	1.7550	0.9400	3*4Y	6.50	0.00
-80.50	-6.00	4Y	1.4000	-1.50	1.8000	0.9600	3*5Y	12.50	0.00
-79.00	-6.00	5Y	1.4600	-1.50	1.8500	0.9800	4*5Y	6.00	0.00
-69.75	-6.50	7Y	1.6000	-1.50	1.8950	1.0050	5*7Y	14.00	0.00
-56.25	-6.50	10Y	1.8050	-1.50	2.0500	1.0200	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	2.4743	0.0086	2.4657	2.4359	2.4315	2.4743	1.0580	2.4743	0.3000
10Y	2.9757	0.0141	2.9616	2.9122	2.8668	2.9757	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	33.23	-1.64	34.87	32.59	32.15	34.87	-69.60	34.87	-251.80
10Y	25.37	-4.29	29.66	27.22	22.48	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	32.75	2.50	30.25	29.50	29.75	42.50	19.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	58.00	3.20	54.80	53.00	53.20	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	50.14	0.55	49.59	47.63	43.53	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	86								
1.5Y	95.75 / 96 / 96.25								
02Y	3.75 / 4.25	SPRD	4*5Y 4.5						
03Y			1.5*2Y 08						
04Y	20.25								
05Y	25.25 / 25 / 24.75								
07Y									
10Y	35 / 35.5 / 36.75								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	97 건	13	84	65	74	89	54	124	
금 액	27,425 억원	-815	28,240	17,940	21,140	25,050	12,760	36,215	

장중동향
국고채 금리, 상승.
미국 국채 금리 상승 부담에 외국인인 3년 국채선물을 대량 매도하면서 약세장이 이어짐.

IRS, 상승. 커브 스티프닝.
그간 낮은 금리에 익숙했던 투자자들이 미국 금리 급등에 포지션을 푸는 모습이 연출됨. 5년 초과 구간에서는 비드가 우위에 있었음.

CRS, 거래없이 하락 마감.