IPS Daily Morning Brief

2018-04-30

종가 기준일 2018-04-27

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7275	-0.50	1.7385	1.7204	1.7145	1.7450	1.3900	2.6700	1.2875
9M	1.7900	-0.50	1.7980	1.7780	1.7770	1.8125	1.4100	2.6925	1.2500
1Y	1.8500	-1.25	1.8635	1.8338	1.8377	1.8850	1.4350	2.7225	1.2200
1.5Y	1.9450	-1.25	1.9590	1.9276	1.9445	2.0050	1.4625	2.7875	1.1900
2Y	2.0175	-1.75	2.0370	1.9956	2.0256	2.1000	1.4700	2.8525	1.1675
3Y	2.1150	-2.75	2.1395	2.0889	2.1319	2.2175	1.5050	2.9825	1.1550
4Y	2.1850	-3.25	2.2100	2.1491	2.1998	2.2950	1.5625	3.1075	1.1575
5Y	2.2275	-4.00	2.2560	2.1921	2.2469	2.3400	1.6125	3.2125	1.1575
7Y	2.2775	-4.00	2.3050	2.2386	2.3000	2.3950	1.6825	3.3550	1.1675
10Y	2.3450	-4.25	2.3745	2.3071	2.3753	2.4850	1.7700	3.4975	1.2125
12Y	2.3900	-4.25	2.4195	2.3521	2.4178	2.5225	1.7775	3.5375	1.2150
15Y	2.4100	-4.25	2.4395	2.3721	2.4370	2.5400	1.7775	3.5550	1.2150
20Y	2.4325	-4.25	2.4620	2.3946	2.4572	2.5600	1.7000	3.7050	1.2150

6*9M	6.25	0.00	5.95	5.76	6.25	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	6.00	-0.75	6.55	5.58	6.07	10.50	-1.25	10.50	-4.25
1*2Y	16.75	-0.50	17.35	16.19	18.79	23.00	0.50	23.00	-5.50
2*3Y	9.75	-1.00	10.25	9.32	10.63	13.25	3.00	13.75	-1.75
2*4Y	16.75	-1.50	17.30	15.35	17.42	21.75	7.00	27.75	-1.75
2*5Y	21.00	-2.25	21.90	19.65	22.13	27.25	9.75	38.50	-1.75
3*4Y	7.00	-0.50	7.05	6.03	6.79	8.50	2.75	14.00	-0.50
3*5Y	11.25	-1.25	11.65	10.33	11.50	14.00	5.25	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	-0.75	4.60	4.30	4.71	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	5.00	0.00	4.90	4.65	5.30	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	11.75	-0.25	11.85	11.50	12.84	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	-0.25	6.95	6.85	7.54	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.50	4.25	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.50	6.16	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.75	8.75	8.18	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	-1.10	1.856	1.854	1.877	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.008	-1.00	2.017	2.005	2.040	2.108	1.517	2.775	1.232
2Y	2.117	-1.80	2.137	2.108	2.157	2.230	1.560	2.840	1.225
3Y	2.200	-2.20	2.224	2.188	2.244	2.315	1.600	2.930	1.200
4Y	2.380	-3.00	2.410	2.362	2.409	2.502	1.722	3.190	1.232
5Y	2.467	-3.30	2.495	2.429	2.486	2.602	1.770	3.320	1.217
7Y	2.595	-3.90	2.627	2.556	2.619	2.728	1.965	3.510	1.270
10Y	2.695	-4.50	2.729	2.648	2.707	2.812	2.047	3.700	1.355
20Y	2.697	-4.30	2.734	2.665	2.703	2.792	2.110	3.905	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.45	-5.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.76	0.10	107.74	107.77	107.70
LKTB	119.91	0.47	119.74	119.91	119.61

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	-0.15	0.79	-1.98	-3.96	9.00	-16.60	11.00	-17.75
1.5Y	-6.30	-0.25	-5.78	-7.70	-9.52	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-9.95	0.05	-10.00	-11.28	-13.12	-1.35	-22.25	5.50	-25.15
3Y	-8.50	-0.55	-8.45	-9.86	-11.21	4.75	-17.65	8.75	-19.50
4Y	-19.50	-0.25	-19.98	-21.31	-20.92	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.95	-0.70	-23.88	-23.73	-23.95	-9.60	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.75	-0.10	-32.18	-31.78	-31.88	-21.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-35.00	0.25	-35.43	-34.08	-33.15	-23.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.45	0.05	-27.16	-27.03	-24.57	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-72.50	-2.25
-78.50	-1.75
-80.75	-1.25
-81.50	-0.25
-82.00	0.75
-80.25	1.50
-70.25	1.50
-55.50	1.25

CRS

USD/KRW 1076.60 (-3.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1250	-3.50	1.6200	0.7650	1*2Y	8.50	0.50
1.5Y	1.1600	-3.00	1.6600	0.8100	2*3Y	9.00	0.00
2Y	1.2100	-3.00	1.6950	0.8650	2*5Y	21.50	0.50
3Y	1.3000	-3.00	1.7550	0.9550	3*4Y	6.50	0.50
4Y	1.3650	-2.50	1.8000	1.0150	3*5Y	12.50	0.50
5Y	1.4250	-2.50	1.8500	1.0350	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.5750	-2.50	1.8950	1.0400	5*7Y	15.00	0.00
10Y	1.7900	-3.00	2.0500	1.0500	5*10Y	36.50	-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	2.4383	-0.0451	2.4834	2.4913	2.4705	2.4913	1.0910	2.4913	0.3000
10Y	2.9638	-0.0195	2.9833	3.0282	3.0028	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	32.13	-2.71	34.84	33.53	33.55	34.87	-69.10	34.87	-251.80
10Y	26.88	2.55	24.33	26.12	28.28	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	35.25	35.00	33.00	42.50	19.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	57.80	-2.70	60.50	61.10	58.50	68.70	35.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	52.55	2.56	49.99	53.69	53.23	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6y 26
06M			
09M	79		
01Y	85		
1.5Y			
02Y	1.25	SPRD	
03Y			
04Y			
05Y	25.5		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	55 건	-33	88	139	97	97	84	65
금 액	15,075 억원	-10,210	25,285	44,243	25,955	27,425	28,240	17,940

장중동향

국고채 금리하락. 미금리가 3%대 아래로하락한것을 주요인으로 남북정상회담이 낙관적 분위기로 흘러가면서 강세장을 이끔. 장기물의 강세가 크게 반응하며 커브 플래트닝.

IRS는 채권과 연동해 레벨 하락, 커브 스티프닝 마감. 오전은 남북정상회담으로 거래가 뜸하다가 오후들어 거래가 늘어남. 종일 오퍼리쉬해 비드가 나오면 기븐되며 거래.

CRS는 IRS에 비해 활발히 거래되며 레벨 하락.