

IPS Daily Morning Brief

2018-03-02

종가 기준일 2018-03-01

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7125	0.00	1.7145	1.6980	1.6979	1.7200	1.3050	2.6775	1.2875
9M	1.7800	0.50	1.7780	1.7648	1.7622	1.8025	1.2850	2.7075	1.2500
1Y	1.8425	0.75	1.8385	1.8298	1.8306	1.8850	1.2700	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9450	1.00	1.9415	1.9469	1.9361	2.0050	1.2550	2.8100	1.1900
2Y	2.0350	1.00	2.0325	2.0383	2.0128	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1500	0.75	2.1510	2.1574	2.1070	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2225	0.75	2.2255	2.2351	2.1676	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.2750	0.50	2.2815	2.2910	2.2106	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3350	0.50	2.3440	2.3541	2.2565	2.3950	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4250	0.50	2.4350	2.4418	2.3232	2.4850	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.4650	0.50	2.4750	2.4799	2.3617	2.5225	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.4825	0.50	2.4925	2.4974	2.3768	2.5400	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5025	0.50	2.5125	2.5165	2.3868	2.5600	1.2625	3.7325	1.2150

6*9M	6.75	0.50	6.35	6.68	6.43	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.25	0.25	6.05	6.50	6.84	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	19.25	0.25	19.40	20.85	18.22	23.00	-3.75	23.00	-5.50
2*3Y	11.50	-0.25	11.85	11.91	9.43	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	18.75	-0.25	19.30	19.69	15.48	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	24.00	-0.50	24.90	25.28	19.78	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	7.25	0.00	7.45	7.78	6.05	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	12.50	-0.25	13.05	13.36	10.36	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.25	-0.25	5.60	5.59	4.30	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.00	0.00	6.25	6.31	4.59	10.50	1.00	15.25	0.25
5*10Y	15.00	0.00	15.35	15.08	11.25	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	9.00	0.00	9.10	8.76	6.66	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.81	3.85	4.50	0.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.75	0.00	5.75	5.56	5.37	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.75	0.00	7.75	7.48	6.37	7.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.857	0.00	1.858	1.862	1.843	1.890	1.338	2.720	1.237
1.5Y	2.036	0.10	2.038	2.050	2.012	2.080	1.319	2.820	1.232
2Y	2.175	0.80	2.171	2.180	2.129	2.230	1.297	2.920	1.225
3Y	2.265	0.50	2.264	2.275	2.193	2.315	1.250	3.050	1.200
4Y	2.407	0.20	2.408	2.424	2.350	2.496	1.312	3.280	1.232
5Y	2.517	0.20	2.518	2.533	2.435	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.657	0.30	2.663	2.676	2.565	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.735	0.30	2.749	2.768	2.631	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.742	0.20	2.753	2.741	2.594	2.792	1.457	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.50	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.74	-0.01	107.70	107.75	107.69
LKTb	119.63	-0.07	119.50	119.69	119.42

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-1.45	0.75	-1.97	-3.21	-1.24	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-9.10	0.90	-9.61	-10.31	-7.60	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-14.00	0.20	-13.85	-14.22	-11.58	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.50	0.25	-11.34	-11.80	-8.62	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-18.45	0.55	-18.29	-18.84	-18.23	-8.20	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-24.20	0.30	-23.69	-24.17	-22.40	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.20	0.20	-31.86	-32.15	-30.80	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.00	0.20	-31.42	-32.59	-30.74	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-23.95	0.30	-24.03	-22.44	-20.70	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1082.80 (0.00)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-50.25	3.25	1Y	1.3400	4.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00	
-54.50	3.00	1.5Y	1.4000	4.00	1.6600	0.9150	2*3Y	2.05	0.00	
-58.50	3.50	2Y	1.4500	4.50	1.6950	0.8850	2*5Y	19.50	-2.00	
-63.00	1.75	3Y	1.5200	2.50	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	0.00	
-63.75	1.75	4Y	1.5850	2.50	1.8000	0.8400	3*5Y	12.50	0.00	
-63.00	2.00	5Y	1.6450	2.50	1.8500	0.8350	4*5Y	6.00	0.00	
-58.00	2.00	7Y	1.7550	2.50	1.8950	0.8050	5*7Y	11.00	0.00	
-51.50	2.00	10Y	1.9100	2.50	2.0150	0.7900	5*10Y	26.50	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	2.2097	-0.0403	2.2500	2.2661	2.2260	2.2661	0.7400	2.2661	0.2800
10Y	2.8051	-0.0573	2.8624	2.8971	2.8642	2.9500	1.5600	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	3.47	-4.83	8.30	9.91	5.90	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	7.01	-6.03	13.04	16.51	11.42	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	39.00	-0.50	39.50	39.50	41.00	42.50	3.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	56.00	-0.50	56.50	56.50	58.30	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	59.54	-1.70	61.24	63.10	63.82	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M									
09M	78.25								
01Y	84.25								
1.5Y									
02Y			SPRD	1*1.5y 10.25					
03Y	14.75 / 15 / 15.25 / 15.75								
04Y									
05Y	27.5 / 27.75								
07Y	34.5								
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y 44, 45								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	150 건		68	82	82	52	104	126	101
금 액	67,305 억원		40,645	26,660	26,660	11,255	49,970	61,225	32,607

장중동향

제품 파월 의장의 매파적 발언으로인한 미국채 금리상승 여파로 국채 금리 상승. 약세 출발한 국채선물은 외국인의 매수로 약세 폭을 줄이며 마감.

IRS는 선물에 연동해 움직였고, 전구간 소폭 상승. 단기쪽 거래가 활발했고. 5년, 7년 10년 주오테너도 꾸준한 거래.

CRS도 전구간 상승마감.