

IPS Daily Morning Brief

2018-03-05

종가 기준일 2018-03-02

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7375	2.50	1.7180	1.7004	1.6988	1.7375	1.3050	2.6775	1.2875
9M	1.8100	3.00	1.7835	1.7676	1.7633	1.8100	1.2850	2.7075	1.2500
1Y	1.8725	3.00	1.8445	1.8324	1.8318	1.8850	1.2700	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9800	3.50	1.9465	1.9488	1.9378	2.0050	1.2550	2.8100	1.1900
2Y	2.0725	3.75	2.0370	2.0405	2.0151	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1875	3.75	2.1540	2.1593	2.1102	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2550	3.25	2.2260	2.2363	2.1710	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.3000	2.50	2.2790	2.2916	2.2142	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3525	1.75	2.3385	2.3544	2.2604	2.3950	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4325	0.75	2.4270	2.4424	2.3273	2.4850	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.4725	0.75	2.4670	2.4806	2.3659	2.5225	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.4900	0.75	2.4845	2.4981	2.3812	2.5400	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5100	0.75	2.5045	2.5174	2.3916	2.5600	1.2625	3.7325	1.2150

6*9M	7.25	0.50	6.55	6.73	6.46	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.25	0.00	6.10	6.48	6.85	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	20.00	0.75	19.25	20.81	18.33	23.00	-3.75	23.00	-5.50
2*3Y	11.50	0.00	11.70	11.88	9.50	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	18.25	-0.50	18.90	19.58	15.58	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	22.75	-1.25	24.20	25.11	19.90	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	6.75	-0.50	7.20	7.70	6.08	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	11.25	-1.25	12.50	13.24	10.40	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	-0.75	5.30	5.54	4.32	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	5.25	-0.75	5.95	6.28	4.62	10.50	1.00	15.25	0.25
5*10Y	13.25	-1.75	14.80	15.08	11.32	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	8.00	-1.00	8.85	8.80	6.70	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.82	3.85	4.50	0.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.75	0.00	5.75	5.57	5.39	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.75	0.00	7.75	7.50	6.43	7.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.869	1.20	1.859	1.864	1.843	1.890	1.338	2.720	1.237
1.5Y	2.058	2.20	2.040	2.052	2.014	2.080	1.319	2.820	1.232
2Y	2.208	3.30	2.177	2.183	2.131	2.230	1.297	2.920	1.225
3Y	2.305	4.00	2.269	2.278	2.197	2.315	1.250	3.050	1.200
4Y	2.442	3.50	2.412	2.425	2.353	2.496	1.312	3.280	1.232
5Y	2.554	3.70	2.522	2.534	2.439	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.684	2.70	2.661	2.677	2.569	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.755	2.00	2.741	2.768	2.635	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.760	1.80	2.746	2.744	2.599	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	107.60	-0.14	107.79	107.81	107.56
LKTb	119.44	-0.19	119.90	120.09	119.35

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	0.35	1.80	-1.47	-3.12	-1.16	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-7.80	1.30	-9.35	-10.37	-7.58	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.55	0.45	-13.98	-14.22	-11.61	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.75	-0.25	-11.54	-11.92	-8.67	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-18.70	-0.25	-18.58	-18.85	-18.25	-8.20	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-25.40	-1.20	-24.32	-24.27	-22.50	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.15	-0.95	-32.27	-32.25	-30.87	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.25	-1.25	-31.38	-32.54	-30.80	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-25.00	-1.05	-24.19	-22.64	-20.79	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1080.30 (-2.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-53.25	-3.00	1Y	1.3400	0.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00	
-58.00	-3.50	1.5Y	1.4000	0.00	1.6600	0.9100	2*3Y	2.05	0.00	
-62.25	-3.75	2Y	1.4500	0.00	1.6950	0.8850	2*5Y	19.50	0.00	
-66.75	-3.75	3Y	1.5200	0.00	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	0.00	
-67.00	-3.25	4Y	1.5850	0.00	1.8000	0.8400	3*5Y	12.50	0.00	
-65.50	-2.50	5Y	1.6450	0.00	1.8500	0.8350	4*5Y	6.00	0.00	
-59.75	-1.75	7Y	1.7550	0.00	1.8950	0.8050	5*7Y	11.00	0.00	
-52.25	-0.75	10Y	1.9100	0.00	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	2.2540	0.0443	2.2097	2.2500	2.2661	2.2661	0.7400	2.2661	0.2800
10Y	2.8625	0.0574	2.8051	2.8624	2.8971	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	4.60	1.13	3.47	8.30	9.91	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	10.75	3.74	7.01	13.04	16.51	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	36.00	-3.00	39.00	39.50	39.50	42.50	3.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	54.70	-1.30	56.00	56.50	56.50	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	60.85	1.31	59.54	61.24	63.10	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	73.5								
09M									
01Y	83.75								
1.5Y	93 / 93.25								
02Y					SPRD	1*1.5Y 9.75			
03Y	18.75 / 18.5					3*5Y 11.75			
04Y									
05Y	24								
07Y									
10Y	38 / 37.5 / 37								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y 44, 45								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	131 건		-19	150	82	82	52	104	126
금 액	38,275 억원		-29,030	67,305	26,660	26,660	11,255	49,970	61,225

장중동향

국고채 금리 상승

국채선물은 미국 금리 하락을 반영해 장 초반부터 강세를 보였지만 마감을 30분경 앞두고 이주열 총재 연임설과 BOJ의 출구전략 검토 보도로 시장은 약세로 급격하게 전환됐음.

IRS, 전 구간에서 상승.

오전 중 금리가 하락하기도 했지만 구로다 하루히코 일본은행 총재와 이주열 한국은행 총재 연임 소식에 상승 반전. 특히 오전 중에 10년 중심으로 오퍼리쉬 (포린오퍼/증권비드).