

IPS Daily Morning Brief

2018-03-23

종가 기준일 2018-03-22

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7050	-1.00	1.7160	1.7249	1.7064	1.7400	1.3325	2.6700	1.2875
9M	1.7700	-1.25	1.7780	1.7889	1.7727	1.8125	1.3225	2.7075	1.2500
1Y	1.8350	-1.50	1.8420	1.8514	1.8409	1.8850	1.3175	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9375	-2.00	1.9520	1.9621	1.9534	2.0050	1.3100	2.8100	1.1900
2Y	2.0225	-2.25	2.0390	2.0495	2.0375	2.1000	1.3000	2.8850	1.1675
3Y	2.1350	-2.50	2.1505	2.1599	2.1421	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.2050	-2.50	2.2210	2.2289	2.2080	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.2500	-2.50	2.2675	2.2756	2.2540	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.2975	-2.75	2.3155	2.3290	2.3048	2.3950	1.3900	3.3800	1.1675
10Y	2.3625	-3.00	2.3865	2.4074	2.3771	2.4850	1.4425	3.5250	1.2125
12Y	2.4075	-3.00	2.4315	2.4501	2.4172	2.5225	1.4500	3.5600	1.2150
15Y	2.4275	-3.00	2.4515	2.4693	2.4338	2.5400	1.4525	3.5825	1.2150
20Y	2.4475	0.00	2.4655	2.4878	2.4489	2.5600	1.4375	3.7325	1.2150

6*9M	6.50	-0.25	6.20	6.40	6.63	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.50	-0.25	6.40	6.25	6.82	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	18.75	-0.75	19.70	19.81	19.66	23.00	-3.25	23.00	-5.50
2*3Y	11.25	-0.25	11.15	11.04	10.46	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	18.25	-0.25	18.20	17.94	17.05	21.75	1.00	27.75	-1.75
2*5Y	22.75	-0.25	22.85	22.61	21.65	27.25	3.25	38.50	-1.75
3*4Y	7.00	0.00	7.05	6.90	6.59	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.50	0.00	11.70	11.58	11.19	14.00	2.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.65	4.67	4.60	6.25	1.75	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	-0.25	4.80	5.34	5.08	10.50	2.00	15.25	0.25
5*10Y	11.25	-0.50	11.90	13.18	12.31	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	-0.25	7.10	7.84	7.23	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.28	4.01	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.19	5.68	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.50	3.00	7.90	8.04	7.18	8.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.908	-2.00	1.924	1.903	1.861	1.935	1.395	2.720	1.237
1.5Y	2.027	-3.80	2.060	2.066	2.037	2.108	1.397	2.820	1.232
2Y	2.145	-4.50	2.182	2.191	2.162	2.230	1.375	2.920	1.225
3Y	2.245	-4.20	2.272	2.280	2.241	2.315	1.351	3.050	1.200
4Y	2.437	-3.50	2.460	2.441	2.404	2.502	1.447	3.280	1.232
5Y	2.475	-3.50	2.498	2.520	2.491	2.602	1.422	3.410	1.217
7Y	2.601	-3.50	2.628	2.653	2.622	2.728	1.527	3.563	1.270
10Y	2.687	-3.50	2.716	2.734	2.696	2.812	1.597	3.750	1.355
20Y	2.681	-1.40	2.694	2.731	2.665	2.792	1.655	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	107.54	0.13	107.45	107.55	107.45
LKTB	119.82	0.34	119.53	119.82	119.50

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	-7.30	0.50	-8.20	-5.19	-2.05	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-8.95	1.80	-10.80	-10.37	-8.40	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-12.25	2.25	-14.32	-14.16	-12.41	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.00	1.70	-12.19	-12.01	-9.88	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-23.20	1.00	-23.86	-21.21	-19.58	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-22.50	1.00	-23.09	-24.45	-23.73	-5.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-30.35	0.75	-31.23	-32.38	-31.75	-13.20	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.45	0.50	-32.97	-32.69	-31.91	-14.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-23.35	1.40	-22.83	-24.30	-21.61	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1072.70 (+0.40)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-64.00	-11.00	1Y	1.1950	-12.50	1.6200	0.7650	1*2Y	15.00	3.00	
-66.25	-8.50	1.5Y	1.2750	-10.50	1.6600	0.9100	2*3Y	10.00	1.00	
-67.75	-7.25	2Y	1.3450	-9.50	1.6950	0.8850	2*5Y	21.00	1.00	
-69.00	-6.00	3Y	1.4450	-8.50	1.7550	0.8550	3*4Y	5.50	0.00	
-70.50	-6.00	4Y	1.5000	-8.50	1.8000	0.8400	3*5Y	11.00	0.00	
-69.50	-6.00	5Y	1.5550	-8.50	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	0.00	
-61.25	-4.75	7Y	1.6850	-7.50	1.8950	0.8050	5*7Y	13.00	1.00	
-50.75	-3.50	10Y	1.8550	-6.50	2.0500	0.8100	5*10Y	30.00	2.00	

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	2.2786	-0.0207	2.2993	2.3489	2.3157	2.3489	0.7800	2.3489	0.2800
10Y	2.8247	-0.0586	2.8833	2.8971	2.8576	2.9500	1.7400	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	13.36	2.43	10.93	15.69	12.37	15.69	-70.50	15.69	-264.00
10Y	13.77	-2.36	16.13	16.51	13.26	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	34.00	-0.75	34.75	35.00	35.50	42.50	11.25	68.25	2.75
KTb 2*10Y	54.20	1.00	53.20	54.00	53.30	68.70	20.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	54.61	-3.79	58.40	54.82	54.19	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M									
09M									
01Y	84 / 84.25								
1.5Y	94.5 / 94.75								
02Y	3.25 / 04		SPRD	6*12M	13.5				
03Y	13.75 / 13.5 / 14.75			3*4Y	07				
04Y	20.5 / '21.25 / 21.75			5*10Y	11				
05Y	25 / 25.5 / 26.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y CCS 27								
	2y CCS 35								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황		145 건	57	88	91	86	85	96	98
금 액		40,690 억원	10,170	30,520	22,375	37,335	34,015	27,800	26,468

장중동향

국고채 금리, 금리 하락 마감.

FOMC 점도표에서 올해 금리 인상 전망이 세 차례로 유지된 점 등이 불확실성 해소 요인으로 작용.

IRS, 금리 하락 마감.

현물 금리가 하락하는 중에도 상대적으로 비दी쉬한 모습이 연출되면서 상대적으로 제한적 하락.

CRS, 금리 금락.

FX스왑 지지선이 무너지면서 에셋스왑이 물밀듯이 들어와 금리 금락.