

IPS Daily Morning Brief

2018-03-26

종가 기준일 2018-03-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7050	0.00	1.7135	1.7241	1.7065	1.7400	1.3650	2.6700	1.2875
9M	1.7650	-0.50	1.7755	1.7880	1.7728	1.8125	1.3400	2.7075	1.2500
1Y	1.8200	-1.50	1.8385	1.8503	1.8408	1.8850	1.3250	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9175	-2.00	1.9445	1.9603	1.9533	2.0050	1.3100	2.8100	1.1900
2Y	2.0025	-2.00	2.0310	2.0471	2.0376	2.1000	1.3000	2.8850	1.1675
3Y	2.1100	-2.50	2.1425	2.1568	2.1429	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.1775	-2.75	2.2125	2.2251	2.2094	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.2175	-3.25	2.2580	2.2709	2.2555	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.2650	-3.25	2.3060	2.3233	2.3066	2.3950	1.3900	3.3800	1.1675
10Y	2.3275	-3.50	2.3745	2.4001	2.3792	2.4850	1.4425	3.5250	1.2125
12Y	2.3725	-3.50	2.4195	2.4431	2.4195	2.5225	1.4500	3.5600	1.2150
15Y	2.3925	-3.50	2.4395	2.4624	2.4363	2.5400	1.4525	3.5825	1.2150
20Y	2.4125	-3.50	2.4535	2.4809	2.4516	2.5600	1.4375	3.7325	1.2150

6*9M	6.00	-0.50	6.20	6.39	6.63	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	5.50	-1.00	6.30	6.23	6.80	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	18.25	-0.50	19.25	19.69	19.69	23.00	-3.25	23.00	-5.50
2*3Y	10.75	-0.50	11.15	10.96	10.53	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	17.50	-0.75	18.15	17.80	17.18	21.75	1.00	27.75	-1.75
2*5Y	21.50	-1.25	22.70	22.38	21.79	27.25	3.25	38.50	-1.75
3*4Y	6.75	-0.25	7.00	6.84	6.65	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.75	-0.75	11.55	11.41	11.26	14.00	2.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	-0.50	4.55	4.57	4.61	6.25	1.75	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	4.80	5.24	5.11	10.50	2.00	15.25	0.25
5*10Y	11.00	-0.25	11.65	12.93	12.37	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	-0.25	6.85	7.69	7.26	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.30	4.03	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.23	5.70	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.50	0.00	7.90	8.08	7.24	8.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.898	-1.00	1.918	1.905	1.862	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.016	-1.10	2.049	2.064	2.037	2.108	1.415	2.820	1.232
2Y	2.130	-1.50	2.170	2.189	2.162	2.230	1.390	2.920	1.225
3Y	2.222	-2.30	2.263	2.277	2.242	2.315	1.375	3.050	1.200
4Y	2.407	-3.00	2.450	2.440	2.406	2.502	1.455	3.280	1.232
5Y	2.435	-4.00	2.486	2.515	2.493	2.602	1.429	3.410	1.217
7Y	2.564	-3.70	2.615	2.646	2.624	2.728	1.527	3.563	1.270
10Y	2.650	-3.70	2.703	2.727	2.699	2.812	1.597	3.750	1.355
20Y	2.655	-2.60	2.689	2.724	2.668	2.792	1.655	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.46	-4.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.65	0.11	107.63	107.67	107.60
LKTB	120.21	0.39	120.25	120.29	120.11

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	-7.80	-0.50	-7.95	-5.48	-2.15	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-9.85	-0.90	-10.47	-10.41	-8.42	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-12.75	-0.50	-13.88	-14.15	-12.46	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.20	-0.20	-12.03	-12.04	-9.95	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-22.95	0.25	-23.75	-21.49	-19.63	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-21.75	0.75	-22.84	-24.42	-23.73	-5.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.90	0.45	-30.92	-32.32	-31.76	-13.20	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.25	0.20	-32.87	-32.68	-32.00	-14.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.25	-0.90	-23.51	-24.30	-21.68	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1082.20 (+9.50)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-73.00	-9.00	1Y	1.0900	-10.50	1.6200	0.7650	1*2Y	20.50	5.50	
-71.25	-5.00	1.5Y	1.2050	-7.00	1.6600	0.9100	2*3Y	12.00	2.00	
-70.75	-3.00	2Y	1.2950	-5.00	1.6950	0.8850	2*5Y	25.00	4.00	
-69.50	-0.50	3Y	1.4150	-3.00	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	1.00	
-69.75	0.75	4Y	1.4800	-2.00	1.8000	0.8400	3*5Y	13.00	2.00	
-67.25	2.25	5Y	1.5450	-1.00	1.8500	0.8350	4*5Y	6.50	1.00	
-59.00	2.25	7Y	1.6750	-1.00	1.8950	0.8050	5*7Y	13.00	0.00	
-48.25	2.50	10Y	1.8450	-1.00	2.0500	0.8100	5*10Y	30.00	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	2.2662	-0.0124	2.2786	2.2993	2.3489	2.3489	0.7800	2.3489	0.2800
10Y	2.8165	-0.0082	2.8247	2.8833	2.8971	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	13.62	0.26	13.36	10.93	15.69	15.69	-70.50	15.69	-264.00
10Y	16.65	2.88	13.77	16.13	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	32.50	-1.50	34.00	34.75	35.00	42.50	11.25	68.25	2.75
KTb 2*10Y	52.00	-2.20	54.20	53.20	54.00	68.70	20.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	55.03	0.42	54.61	58.40	54.82	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6Y 24 / 23.75						
06M									
09M									
01Y	82.5 / 82								
1.5Y	91.75								
02Y	00 / 99.75 / 0.25	SPRD	1*2Y 17.75						
03Y	10.75		1*3Y 29						
04Y	17.25		4*6Y 6.5						
05Y	22.5 / 22 / 21.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	135 건	-10	145	88	91	86	85	96	
금 액	43,437 억원	2,747	40,690	30,520	22,375	37,335	34,015	27,800	

장중동향

국고채 금리, 금리 하락 마감.

미국 무역전쟁 우려에 따른 안전자산 선호로 금리 하락. 국채선물은 장중 주식시장이 큰 폭으로 하락하고 재정거래 수요가 들어오면서 강세 흐름이 유지됐으나 외국인의 순매수 규모가 작아 강세 폭은 제한됐음.

IRS, 금리 하락 마감.

커브 플래트닝. 안전자산 선호에 오퍼 수요가 많아졌음.

CRS, 금리 하락마감.