

IPS Daily Morning Brief

2018-03-28

종가 기준일 2018-03-27

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7150	0.25	1.7105	1.7241	1.7069	1.7400	1.3650	2.6700	1.2875
9M	1.7750	0.25	1.7730	1.7878	1.7735	1.8125	1.3400	2.7075	1.2500
1Y	1.8350	0.25	1.8345	1.8500	1.8412	1.8850	1.3250	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9375	0.50	1.9365	1.9601	1.9539	2.0050	1.3100	2.8100	1.1900
2Y	2.0200	0.25	2.0215	2.0464	2.0387	2.1000	1.3000	2.8850	1.1675
3Y	2.1325	0.00	2.1340	2.1555	2.1454	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.2000	-0.25	2.2030	2.2234	2.2130	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.2400	-1.00	2.2465	2.2679	2.2594	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.2925	-1.00	2.2965	2.3193	2.3112	2.3950	1.3950	3.3800	1.1675
10Y	2.3550	-1.00	2.3605	2.3933	2.3843	2.4850	1.4650	3.5250	1.2125
12Y	2.4000	-1.00	2.4055	2.4368	2.4250	2.5225	1.4750	3.5600	1.2150
15Y	2.4200	-1.00	2.4255	2.4563	2.4420	2.5400	1.4750	3.5825	1.2150
20Y	2.4400	-1.00	2.4395	2.4748	2.4580	2.5600	1.4525	3.7325	1.2150

6*9M	6.00	0.00	6.25	6.36	6.66	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.00	0.00	6.15	6.23	6.77	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	18.50	0.00	18.70	19.64	19.75	23.00	-2.50	23.00	-5.50
2*3Y	11.25	-0.25	11.25	10.91	10.67	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	18.00	-0.50	18.15	17.70	17.43	21.75	1.00	27.75	-1.75
2*5Y	22.00	-1.25	22.50	22.15	22.07	27.25	3.25	38.50	-1.75
3*4Y	6.75	-0.25	6.90	6.79	6.75	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.75	-1.00	11.25	11.24	11.40	14.00	2.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	-0.75	4.35	4.45	4.65	6.25	2.00	11.25	-0.25
5*7Y	5.25	0.00	5.00	5.14	5.18	10.50	2.25	15.25	0.25
5*10Y	11.50	0.00	11.40	12.54	12.49	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.00	6.40	7.40	7.31	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.35	4.06	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.30	5.76	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.50	0.00	7.90	8.15	7.37	8.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.899	0.10	1.906	1.909	1.864	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.031	0.00	2.034	2.064	2.038	2.108	1.415	2.820	1.232
2Y	2.142	-0.80	2.151	2.187	2.164	2.230	1.390	2.920	1.225
3Y	2.225	-2.00	2.245	2.275	2.246	2.315	1.385	3.050	1.200
4Y	2.422	-1.80	2.436	2.443	2.411	2.502	1.477	3.280	1.232
5Y	2.457	-1.00	2.469	2.510	2.497	2.602	1.455	3.410	1.217
7Y	2.584	-1.60	2.597	2.640	2.629	2.728	1.557	3.563	1.270
10Y	2.670	-2.00	2.684	2.721	2.706	2.812	1.632	3.750	1.355
20Y	2.662	-2.80	2.677	2.717	2.676	2.792	1.687	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	107.63	0.04	107.59	107.63	107.57
LKTb	120.03	0.20	119.88	120.03	119.80

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	-6.40	0.15	-7.17	-5.92	-2.33	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-9.35	0.50	-9.75	-10.37	-8.45	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-12.20	1.05	-12.99	-14.01	-12.57	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-9.25	2.00	-11.08	-11.93	-10.07	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-22.20	1.55	-23.26	-21.95	-19.76	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-21.70	0.00	-22.23	-24.22	-23.74	-5.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.15	0.60	-30.05	-32.09	-31.78	-13.20	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.50	1.00	-32.33	-32.76	-32.16	-14.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-22.20	1.80	-23.71	-24.23	-21.76	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1070.30 (-10.80)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-66.00	7.75	1Y	1.1750	8.00	1.6200	0.7650	1*2Y	19.00	-0.50		
-65.75	7.50	1.5Y	1.2800	8.00	1.6600	0.9100	2*3Y	12.00	-0.50		
-65.50	7.25	2Y	1.3650	7.50	1.6950	0.8850	2*5Y	25.00	-0.50		
-64.75	7.00	3Y	1.4850	7.00	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	0.00		
-65.00	7.25	4Y	1.5500	7.00	1.8000	0.8400	3*5Y	13.00	0.00		
-62.50	8.00	5Y	1.6150	7.00	1.8500	0.8350	4*5Y	6.50	0.00		
-54.75	8.00	7Y	1.7450	7.00	1.8950	0.8050	5*7Y	13.00	0.00		
-44.00	8.00	10Y	1.9150	7.00	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	2.2741	-0.0046	2.2787	2.2662	2.2786	2.3489	0.7800	2.3489	0.2800
10Y	2.7773	-0.0786	2.8559	2.8165	2.8247	2.9500	1.7580	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	13.21	0.34	12.87	13.62	13.36	15.69	-70.50	15.69	-264.00
10Y	10.73	-5.86	16.59	16.65	13.77	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	33.50	-1.25	34.75	32.50	34.00	42.50	11.25	68.25	2.75
KTb 2*10Y	52.80	-1.20	54.00	52.00	54.20	68.70	20.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	50.32	-7.40	57.72	55.03	54.61	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	71									
09M										
01Y	84									
1.5Y	93									
02Y	1.5									
03Y	12.75 / 13 / 13.25				SPRD	1.5*6Y	33.75			
04Y						5*8Y	07			
05Y	24.25 / 24.5					5*10Y	11.25			
07Y										
10Y	35.5									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	3Y CCS 51.5									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			108 건	38	70	135	145	88	91	86
금 액			29,500 억원	13,825	15,675	43,437	40,690	30,520	22,375	37,335

장중동향
국고채 금리, 특별한 이슈 없이 금리 하락 마감. 외인 국채선물 매수.
IRS, 3Y 아래 테너 금리 상승 & 3Y 위 테너 금리 하락. 커브 플랫트닝.
상대적으로 단기구간이 비디쉬한 모습. 3Y과 5Y을 중심으로 거래 활발.

CRS, FX스왑이 안정되면서 전반적 금리 상승 마감.