

IPS Daily Morning Brief

2018-03-29

종가 기준일 2018-03-28

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7125	-0.25	1.7100	1.7241	1.7072	1.7400	1.3650	2.6700	1.2875
9M	1.7725	-0.25	1.7710	1.7876	1.7739	1.8125	1.3400	2.7075	1.2500
1Y	1.8300	-0.50	1.8305	1.8498	1.8415	1.8850	1.3250	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9350	-0.25	1.9320	1.9601	1.9544	2.0050	1.3100	2.8100	1.1900
2Y	2.0100	-1.00	2.0145	2.0456	2.0393	2.1000	1.3000	2.8850	1.1675
3Y	2.1125	-2.00	2.1245	2.1540	2.1464	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.1750	-2.50	2.1920	2.2214	2.2143	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.2150	-2.50	2.2345	2.2651	2.2607	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.2625	-3.00	2.2840	2.3159	2.3127	2.3950	1.3950	3.3800	1.1675
10Y	2.3225	-3.25	2.3465	2.3884	2.3859	2.4850	1.4650	3.5250	1.2125
12Y	2.3675	-3.25	2.3915	2.4321	2.4267	2.5225	1.4750	3.5600	1.2150
15Y	2.3875	-3.25	2.4115	2.4518	2.4438	2.5400	1.4750	3.5825	1.2150
20Y	2.4100	-3.00	2.4320	2.4704	2.4603	2.5600	1.4525	3.7325	1.2150

6*9M	6.00	0.00	6.10	6.35	6.68	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	5.75	-0.25	5.95	6.21	6.75	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	18.00	-0.50	18.40	19.59	19.78	23.00	-2.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.25	-1.00	11.00	10.84	10.71	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	16.50	-1.50	17.75	17.58	17.50	21.75	1.00	27.75	-1.75
2*5Y	20.50	-1.50	22.00	21.95	22.15	27.25	3.25	38.50	-1.75
3*4Y	6.25	-0.50	6.75	6.74	6.79	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	-0.50	11.00	11.11	11.43	14.00	2.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.00	4.25	4.37	4.65	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	-0.50	4.95	5.08	5.20	10.50	2.25	15.25	0.25
5*10Y	10.75	-0.75	11.20	12.33	12.52	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.00	-0.25	6.25	7.25	7.33	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.38	4.08	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.34	5.79	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.25	8.55	8.20	7.43	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.899	0.00	1.900	1.911	1.866	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.032	0.10	2.027	2.064	2.039	2.108	1.415	2.820	1.232
2Y	2.137	-0.50	2.141	2.185	2.165	2.230	1.390	2.920	1.225
3Y	2.222	-0.30	2.232	2.273	2.248	2.315	1.385	3.050	1.200
4Y	2.406	-1.60	2.422	2.443	2.413	2.502	1.477	3.280	1.232
5Y	2.437	-2.00	2.454	2.506	2.498	2.602	1.469	3.410	1.217
7Y	2.558	-2.60	2.581	2.635	2.631	2.728	1.571	3.563	1.270
10Y	2.642	-2.80	2.668	2.716	2.708	2.812	1.645	3.750	1.355
20Y	2.635	-2.70	2.665	2.712	2.678	2.792	1.697	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	107.67	0.04	107.70	107.73	107.67
LKTb	120.34	0.31	120.40	120.47	120.31

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	-6.90	-0.50	-6.99	-6.15	-2.46	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-9.70	-0.35	-9.54	-10.36	-8.49	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-12.70	-0.50	-12.63	-13.94	-12.62	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-10.95	-1.70	-10.73	-11.89	-10.14	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-23.10	-0.90	-23.04	-22.16	-19.84	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-22.20	-0.50	-21.97	-24.10	-23.77	-6.00	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.55	-0.40	-29.74	-31.94	-31.80	-13.70	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.95	-0.45	-32.13	-32.80	-32.23	-15.45	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-22.50	-0.30	-23.26	-24.14	-21.78	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1070.80 (+0.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-48.00	18.00	1Y	1.3500	17.50	1.6200	0.7650	1*2Y	9.00	-10.00	
-53.50	12.25	1.5Y	1.4000	12.00	1.6600	0.9100	2*3Y	9.50	-2.50	
-57.00	8.50	2Y	1.4400	7.50	1.6950	0.8850	2*5Y	22.00	-3.00	
-57.75	7.00	3Y	1.5350	5.00	1.7550	0.8550	3*4Y	5.00	-1.50	
-59.00	6.00	4Y	1.5850	3.50	1.8000	0.8400	3*5Y	12.50	-0.50	
-55.50	7.00	5Y	1.6600	4.50	1.8500	0.8350	4*5Y	7.50	1.00	
-48.25	6.50	7Y	1.7800	3.50	1.8950	0.8050	5*7Y	12.00	-1.00	
-37.25	6.75	10Y	1.9500	3.50	2.0500	0.8100	5*10Y	29.00	-1.00	

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	2.2942	0.0201	2.2741	2.2787	2.2662	2.3489	0.7800	2.3489	0.2800
10Y	2.7846	0.0073	2.7773	2.8559	2.8165	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	15.72	2.51	13.21	12.87	13.62	15.72	-70.50	15.72	-264.00
10Y	14.26	3.53	10.73	16.59	16.65	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	31.25	-2.25	33.50	34.75	32.50	42.50	11.25	68.25	2.75
KTb 2*10Y	50.50	-2.30	52.80	54.00	52.00	68.70	20.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	49.04	-1.28	50.32	57.72	55.03	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	70.5									
09M	77									
01Y	83 / 83.25									
1.5Y	92.75									
02Y	0.5									
03Y					SPRD	9M*2Y 23.5				
04Y						3*5Y 10.25				
05Y	21 / 21.25					10*20Y 8.75				
07Y										
10Y	32 / 32.25 / 32.5									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	3*4Y CCS 05									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			86 건	-22	108	70	135	145	88	91
금 액			24,100 억원	-5,400	29,500	15,675	43,437	40,690	30,520	22,375

장중동향
국고채 금리, 코스피가 1% 넘게 하락한 반작용으로 안전자산 선호가 나타나며 금리 하락. 외인 선물 매수.

IRS, 금리 하락. 커브 플랫트닝.
외인이 국채선물을 매수에 일부 영향을 받으며 금리 하락.
1Y-1.5Y를 중심으로 호가 대치가 활발했으며 거래 다수. 그 위 테너로는 오퍼리시한 모습.

CRS, FX스왑이 이전 수준을 거의 회복하면서 금리 상승. 1Y-1.5Y 구간 크게 올라오며 마감.