

IPS Daily Morning Brief

2018-03-30

종가 기준일 2018-03-29

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7125	0.00	1.7115	1.7241	1.7074	1.7400	1.3650	2.6700	1.2875
9M	1.7725	0.00	1.7715	1.7873	1.7742	1.8125	1.3400	2.7075	1.2500
1Y	1.8300	0.00	1.8295	1.8491	1.8416	1.8850	1.3250	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9350	0.00	1.9315	1.9596	1.9548	2.0050	1.3100	2.8100	1.1900
2Y	2.0075	-0.25	2.0115	2.0443	2.0396	2.1000	1.3000	2.8850	1.1675
3Y	2.1100	-0.25	2.1195	2.1520	2.1470	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.1725	-0.25	2.1855	2.2189	2.2152	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.2125	-0.25	2.2270	2.2620	2.2616	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.2600	-0.25	2.2765	2.3121	2.3138	2.3950	1.3950	3.3800	1.1675
10Y	2.3200	-0.25	2.3380	2.3831	2.3870	2.4850	1.4650	3.5250	1.2125
12Y	2.3650	-0.25	2.3830	2.4271	2.4280	2.5225	1.4750	3.5600	1.2150
15Y	2.3850	-0.25	2.4030	2.4469	2.4453	2.5400	1.4750	3.5825	1.2150
20Y	2.4075	-0.25	2.4240	2.4656	2.4620	2.5600	1.4525	3.7325	1.2150

6*9M	6.00	0.00	6.00	6.31	6.68	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	5.75	0.00	5.80	6.19	6.74	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	17.75	-0.25	18.20	19.51	19.80	23.00	-2.50	23.00	-5.50
2*3Y	10.25	0.00	10.80	10.78	10.74	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	16.50	0.00	17.40	17.46	17.56	21.75	2.25	27.75	-1.75
2*5Y	20.50	0.00	21.55	21.78	22.20	27.25	4.75	38.50	-1.75
3*4Y	6.25	0.00	6.60	6.69	6.82	8.50	1.75	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.00	10.75	11.00	11.46	14.00	4.25	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.00	4.15	4.31	4.65	6.25	2.25	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	4.95	5.01	5.21	10.50	2.50	15.25	0.25
5*10Y	10.75	0.00	11.10	12.11	12.54	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.00	0.00	6.15	7.10	7.33	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.40	4.10	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.38	5.82	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.75	0.00	8.60	8.25	7.50	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.902	0.30	1.899	1.914	1.868	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.031	-0.10	2.028	2.063	2.040	2.108	1.415	2.820	1.232
2Y	2.137	0.00	2.139	2.183	2.166	2.230	1.390	2.920	1.225
3Y	2.220	-0.20	2.227	2.271	2.249	2.315	1.385	3.050	1.200
4Y	2.403	-0.30	2.416	2.443	2.414	2.502	1.477	3.280	1.232
5Y	2.435	-0.20	2.446	2.502	2.500	2.602	1.469	3.410	1.217
7Y	2.555	-0.30	2.572	2.630	2.632	2.728	1.576	3.563	1.270
10Y	2.637	-0.50	2.658	2.711	2.710	2.812	1.650	3.750	1.355
20Y	2.632	-0.30	2.655	2.706	2.680	2.792	1.712	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	107.70	0.03	107.67	107.71	107.66
LKTB	120.35	0.01	120.31	120.52	120.30

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	-7.20	-0.30	-6.97	-6.44	-2.60	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-9.60	0.10	-9.67	-10.38	-8.54	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-12.95	-0.25	-12.77	-13.89	-12.68	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.00	-0.05	-10.73	-11.86	-10.21	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-23.05	0.05	-23.01	-22.39	-19.92	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-22.25	-0.05	-21.92	-24.01	-23.80	-6.00	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.50	0.05	-29.57	-31.81	-31.82	-13.70	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.70	0.25	-31.98	-32.83	-32.30	-15.45	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-22.45	0.05	-23.08	-24.06	-21.80	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS			USD/KRW			1065.90 (-4.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-53.00	-5.00	1Y	1.3000	-5.00	1.6200	0.7650	1*2Y	10.50	1.50
-58.00	-4.50	1.5Y	1.3550	-4.50	1.6600	0.9100	2*3Y	9.50	0.00
-60.25	-3.25	2Y	1.4050	-3.50	1.6950	0.8850	2*5Y	22.00	0.00
-61.00	-3.25	3Y	1.5000	-3.50	1.7550	0.8550	3*4Y	5.00	0.00
-62.25	-3.25	4Y	1.5500	-3.50	1.8000	0.8400	3*5Y	12.50	0.00
-58.75	-3.25	5Y	1.6250	-3.50	1.8500	0.8350	4*5Y	7.50	0.00
-51.50	-3.25	7Y	1.7450	-3.50	1.8950	0.8050	5*7Y	12.00	0.00
-40.50	-3.25	10Y	1.9150	-3.50	2.0500	0.8100	5*10Y	29.00	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	2.2661	-0.0281	2.2942	2.2741	2.2787	2.3489	0.7800	2.3489	0.2800
10Y	2.7392	-0.0454	2.7846	2.7773	2.8559	2.9500	1.7800	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	12.91	-2.81	15.72	13.21	12.87	15.72	-70.50	15.72	-264.00
10Y	10.22	-4.04	14.26	10.73	16.59	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	0.00	31.25	33.50	34.75	42.50	14.25	68.25	2.75
KTb 2*10Y	50.00	-0.50	50.50	52.80	54.00	68.70	22.90	89.00	11.80
UST 2*10Y	47.31	-1.73	49.04	50.32	57.72	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	83								
1.5Y	93 / 93.25								
02Y	1	SPRD	3*10Y		20.75 / 21				
03Y	11 / 11.25		5*10Y		10.75				
04Y			7*12Y		10.5				
05Y	20.75		8*9Y		2.25				
07Y									
10Y	31.5 / 32.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	71 건	-15	86	108	70	135	145	88	
금 액	22,857 억원	-1,243	24,100	29,500	15,675	43,437	40,690	30,520	

장중동향

국고채 금리 보험권에서 혼조. 국채선물은 외국인의 매수가 계속되었지만 강보험권에서 움직이다 보험권으로 되돌아와 마감.

IRS는 6~18개월은 전일비 유지, 그 뒤로 0.25bp 소폭하락. 아웃라잇 전체적으로 오퍼리시하며 거래소식은 조용한 편.

CRS는 fx스왑이 다시 하락하면서 레벨하락. 1년이 5bp 하락해 가장많이 하락.