IPS Daily Morning Brief

2018-03-27

종가 기준일 2018-03-26

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7125	0.75	1.7120	1.7240	1.7066	1.7400	1.3650	2.6700	1.2875
9M	1.7725	0.75	1.7745	1.7878	1.7730	1.8125	1.3400	2.7075	1.2500
1Y	1.8325	1.25	1.8370	1.8500	1.8408	1.8850	1.3250	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9325	1.50	1.9405	1.9600	1.9534	2.0050	1.3100	2.8100	1.1900
2Y	2.0175	1.50	2.0265	2.0466	2.0380	2.1000	1.3000	2.8850	1.1675
3Y	2.1325	2.25	2.1390	2.1560	2.1441	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.2025	2.50	2.2085	2.2241	2.2111	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.2500	3.25	2.2535	2.2694	2.2575	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.3025	3.75	2.3025	2.3211	2.3090	2.3950	1.3900	3.3800	1.1675
10Y	2.3650	3.75	2.3685	2.3965	2.3820	2.4850	1.4425	3.5250	1.2125
12Y	2.4100	3.75	2.4135	2.4398	2.4224	2.5225	1.4500	3.5600	1.2150
15Y	2.4300	3.75	2.4335	2.4591	2.4393	2.5400	1.4525	3.5825	1.2150
20Y	2.4500	3.75	2.4475	2.4776	2.4550	2.5600	1.4375	3.7325	1.2150
6*9M	6.00	0.00	6.25	6.38	6.64	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.00	0.50	6.25	6.23	6.78	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	18.50	0.25	18.95	19.66	19.72	23.00	-3.25	23.00	-5.50
2*3Y	11.50	0.75	11.25	10.94	10.61	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	18.50	1.00	18.20	17.75	17.31	21.75	1.00	27.75	-1.75
2*5Y	23.25	1.75	22.70	22.28	21.95	27.25	3.25	38.50	-1.75
3*4Y	7.00	0.25	6.95	6.81	6.70	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.75	1.00	11.45	11.34	11.35	14.00	2.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	0.75	4.50	4.52	4.64	6.25	1.75	11.25	-0.25
5*7Y	5.25	0.50	4.90	5.18	5.15	10.50	2.00	15.25	0.25
5*10Y	11.50	0.50	11.50	12.71	12.44	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.25	0.00	6.60	7.54	7.29	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.33	4.05	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.26	5.73	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.50	0.00	7.90	8.11	7.30	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	0.00	1.912	1.907	1.863	1.935	1.400	2.720	1.237
1.5Y	2.031	1.50	2.042	2.064	2.038	2.108	1.415	2.820	1.232
2Y	2.150	2.00	2.161	2.188	2.163	2.230	1.390	2.920	1.225
3Y	2.245	2.30	2.257	2.277	2.244	2.315	1.375	3.050	1.200
4Y	2.440	3.30	2.446	2.442	2.408	2.502	1.455	3.280	1.232
5Y	2.467	3.20	2.480	2.513	2.495	2.602	1.429	3.410	1.217
7Y	2.600	3.60	2.609	2.644	2.627	2.728	1.527	3.563	1.270
10Y	2.690	4.00	2.696	2.724	2.703	2.812	1.597	3.750	1.355
20Y	2.690	3.50	2.685	2.721	2.672	2.792	1.655	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.50	4.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.59	-0.06	107.62	107.68	107.58
LKTB	119.83	-0.38	120.05	120.28	119.83

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-6.55	1.25	-7.50	-5.71	-2.23	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-9.85	0.00	-10.11	-10.41	-8.43	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.25	-0.50	-13.49	-14.11	-12.53	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.25	-0.05	-11.78	-12.05	-10.02	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-23.75	-0.80	-23.71	-21.79	-19.70	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-21.70	0.05	-22.63	-24.36	-23.72	-5.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.75	0.15	-30.61	-32.25	-31.77	-13.20	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.50	-0.25	-32.77	-32.75	-32.10	-14.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.00	0.25	-23.77	-24.33	-21.74	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-73.75	-0.75
-73.25	-2.00
-72.75	-2.00
-71.75	-2.25
-72.25	-2.50
-70.50	-3.25
-62.75	-3.75
-52.00	-3.75

CRS

USD/KRW 1081.10 (-1.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.0950	0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	19.50	-1.00
1.5Y	1.2000	-0.50	1.6600	0.9100	2*3Y	12.50	0.50
2Y	1.2900	-0.50	1.6950	0.8850	2*5Y	25.50	0.50
3Y	1.4150	0.00	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	0.00
4Y	1.4800	0.00	1.8000	0.8400	3*5Y	13.00	0.00
5Y	1.5450	0.00	1.8500	0.8350	4*5Y	6.50	0.00
7Y	1.6750	0.00	1.8950	0.8050	5*7Y	13.00	0.00
10Y	1.8450	0.00	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	2.2787	0.0125	2.2662	2.2786	2.2993	2.3489	0.7800	2.3489	0.2800
10Y	2.8559	0.0394	2.8165	2.8247	2.8833	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	12.87	-0.75	13.62	13.36	10.93	15.69	-70.50	15.69	-264.00
10Y	16.59	-0.06	16.65	13.77	16.13	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	34.75	2.25	32.50	34.00	34.75	42.50	11.25	68.25	2.75
KTB 2*10Y	54.00	2.00	52.00	54.20	53.20	68.70	20.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	57.72	2.69	55.03	54.61	58.40	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	82		
1.5Y	91.5		
02Y	1	SPRD	2*4y 18
03Y			4*8y 11
04Y			6*9y 6.5
05Y	22.25 / 24.75 / 25 / 25.25		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y 03 3y 38, 39		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	70 건	-65	135	145	88	91	86	85
금 액	15,675 억원	-27,762	43,437	40,690	30,520	22,375	37,335	34,015

장중동향

채권 금리 상승. 커브 스티프닝.

국채선물은 오후들어 낙폭을 키우며 큰폭으로 하락. 그간 금리 하락이 부담으로 작용하면서, 아시아장의 미국금리 상승, 주식상승 등이 약세로 이끔.

IRS는 채권과 연동해 레벨 상승했고 역시 장기구간으로 갈수록 상승폭이 커져 커브 스팁 마감. 전반적으로 비디시했고 선물종가 이후 5년비드가 강하게 올라오면서 레벨을 올림.

CRS는 전일비 비슷한 수준에 머무름.