IPS Daily Morning Brief

2018-03-06

종가 기준일 2018-03-05

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7350	-0.25	1.7220	1.7024	1.6995	1.7375	1.3050	2.6775	1.2875
9M	1.8125	0.25	1.7905	1.7703	1.7645	1.8125	1.2850	2.7075	1.2500
1Y	1.8750	0.25	1.8520	1.8348	1.8331	1.8850	1.2700	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9825	0.25	1.9555	1.9501	1.9395	2.0050	1.2550	2.8100	1.1900
2Y	2.0700	-0.25	2.0455	2.0416	2.0174	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1750	-1.25	2.1595	2.1590	2.1130	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2375	-1.75	2.2290	2.2349	2.1739	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.2750	-2.50	2.2780	2.2894	2.2172	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3300	-2.25	2.3355	2.3513	2.2637	2.3950	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4075	-2.50	2.4210	2.4391	2.3309	2.4850	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.4475	-2.50	2.4610	2.4775	2.3695	2.5225	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.4650	-2.50	2.4785	2.4950	2.3850	2.5400	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.4850	-2.50	2.4985	2.5144	2.3958	2.5600	1.2625	3.7325	1.2150
6*9M	7.75	0.50	6.85	6.79	6.50	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.25	0.00	6.15	6.45	6.86	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	19.50	-0.50	19.35	20.69	18.43	23.00	-3.75	23.00	-5.50
2*3Y	10.50	-1.00	11.40	11.74	9.55	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	16.75	-1.50	18.35	19.33	15.65	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	20.50	-2.25	23.25	24.78	19.98	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	6.25	-0.50	6.95	7.59	6.10	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	10.00	-1.25	11.85	13.04	10.42	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	3.75	-0.75	4.90	5.45	4.32	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	5.50	0.25	5.75	6.19	4.65	10.50	1.00	15.25	0.25
5*10Y	13.25	0.00	14.30	14.98	11.38	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	7.75	-0.25	8.55	8.79	6.73	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.84	3.86	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	5.75	0.00	5.75	5.59	5.41	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.75	0.00	7.75	7.52	6.48	7.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.887	1.80	1.865	1.865	1.844	1.890	1.338	2.720	1.237
1.5Y	2.068	1.00	2.046	2.054	2.015	2.080	1.319	2.820	1.232
2Y	2.208	0.00	2.185	2.184	2.134	2.230	1.297	2.920	1.225
3Y	2.300	-0.50	2.278	2.279	2.200	2.315	1.250	3.050	1.200
4Y	2.428	-1.40	2.417	2.423	2.357	2.496	1.312	3.280	1.232
5Y	2.535	-1.90	2.527	2.533	2.443	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.659	-2.50	2.662	2.674	2.573	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.725	-3.00	2.736	2.763	2.639	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.729	-3.10	2.742	2.742	2.604	2.792	1.457	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	0.07	107.55	107.68	107.53
LKTB	119.74	0.30	119.44	119.77	119.25

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	-1.20	-1.55	-1.34	-3.07	-1.12	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-8.55	-0.75	-9.09	-10.42	-7.58	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.80	-0.25	-13.95	-14.21	-11.63	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.50	-0.75	-11.85	-11.99	-8.73	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-19.05	-0.35	-18.84	-18.84	-18.27	-8.20	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-26.00	-0.60	-24.92	-24.36	-22.62	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.90	0.25	-32.61	-32.31	-30.93	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.75	0.50	-31.48	-32.43	-30.84	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.40	0.60	-24.37	-22.80	-20.85	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-52.50	0.75
-57.25	0.75
-61.00	1.25
-64.50	2.25
-64.25	2.75
-62.00	3.50
-56.50	3.25
-48.75	3.50

CRS

USD/KRW 1082.00 (+1.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3500	1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00
1.5Y	1.4100	1.00	1.6600	0.9100	2*3Y	2.05	0.00
2Y	1.4600	1.00	1.6950	0.8850	2*5Y	19.50	0.00
3Y	1.5300	1.00	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	0.00
4Y	1.5950	1.00	1.8000	0.8400	3*5Y	12.50	0.00
5Y	1.6550	1.00	1.8500	0.8350	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.7650	1.00	1.8950	0.8050	5*7Y	11.00	0.00
10Y	1.9200	1.00	2.0150	0.7900	5*10Y	26.50	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	2.2458	-0.0082	2.2540	2.2097	2.2500	2.2661	0.7400	2.2661	0.2800
10Y	2.8835	0.0210	2.8625	2.8051	2.8624	2.9500	1.5600	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	3.78	-0.82	4.60	3.47	8.30	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	15.85	5.10	10.75	7.01	13.04	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	33.75	-2.25	36.00	39.00	39.50	42.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	51.70	-3.00	54.70	56.00	56.50	68.70	12.70	89.00	11.80
UST 2*10Y	63.77	2.92	60.85	59.54	61.24	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	11y 42.75 / 43
06M	75 / 75.25		
09M	83 / 83.5		
01Y	89.25 / 90.25		
1.5Y	99 / 0.25		
02Y	08 / 8.75 / 09	SPRD	9m*2y 25.75
03Y	20		1*2y 19
04Y			1.5*2y 8.75
05Y	29.75 / 30 / 31		1.5*3y 19
07Y			1.5*4y 25.5
10Y			2*5y 20.75
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	154 건	23	131	150	82	82	52	104
금 액	28,565 억원	-9,710	38,275	67,305	26,660	26,660	11,255	49,970

장중동향

채권금리는 단기물상승, 장기물하락하며 커브 플래트닝. 하락 출발한 국채선물은 상승 마감했지만 한은총리 연임에 따른 연내금리인상을 반영하며 단기 금리가 약세.

IRS는 단기물 호가와 거래가 많았으며, 오전내 비디시하다가 레벨 부담으로 오퍼가 나오면서 되돌림. 커브는 현물과 연동해 플랫 마감.

CRS는 전구간 1bp 상승 마감.