IPS Daily Morning Brief

2018-03-08

종가 기준일 2018-03-07

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7375	0.00	1.7320	1.7083	1.7009	1.7375	1.3250	2.6775	1.2875
9M	1.8050	0.00	1.8025	1.7764	1.7663	1.8125	1.3125	2.7075	1.2500
1Y	1.8700	0.00	1.8660	1.8410	1.8353	1.8850	1.3025	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9825	0.25	1.9740	1.9559	1.9428	2.0050	1.2925	2.8100	1.1900
2Y	2.0600	-0.50	2.0605	2.0469	2.0218	2.1000	1.2825	2.8850	1.1675
3Y	2.1625	-0.75	2.1690	2.1630	2.1183	2.2175	1.2850	3.0275	1.1550
4Y	2.2200	-1.50	2.2340	2.2373	2.1796	2.2950	1.2925	3.1450	1.1575
5Y	2.2600	-1.50	2.2770	2.2908	2.2230	2.3400	1.3000	3.2400	1.1575
7Y	2.3100	-1.75	2.3310	2.3515	2.2701	2.3950	1.3200	3.3800	1.1675
10Y	2.3800	-2.25	2.4095	2.4388	2.3378	2.4850	1.3700	3.5250	1.2125
12Y	2.4225	-2.25	2.4505	2.4776	2.3765	2.5225	1.3750	3.5600	1.2150
15Y	2.4425	-2.25	2.4690	2.4954	2.3924	2.5400	1.3750	3.5825	1.2150
20Y	2.4625	-2.25	2.4890	2.5150	2.4039	2.5600	1.3650	3.7325	1.2150

6*9M	6.75	0.00	7.05	6.81	6.54	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.50	0.00	6.35	6.46	6.90	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	19.00	-0.50	19.45	20.59	18.65	23.00	-3.25	23.00	-5.50
2*3Y	10.25	-0.25	10.85	11.61	9.65	13.25	-0.25	14.25	-1.75
2*4Y	16.00	-1.00	17.35	19.04	15.79	21.75	0.50	27.75	-1.75
2*5Y	20.00	-1.00	21.65	24.39	20.13	27.25	1.25	38.50	-1.75
3*4Y	5.75	-0.75	6.50	7.43	6.14	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	-0.75	10.80	12.78	10.48	14.00	1.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.00	4.30	5.35	4.34	6.25	0.75	11.25	-0.25
5*7Y	5.00	-0.25	5.40	6.08	4.71	10.50	2.00	15.25	0.25
5*10Y	12.00	-0.75	13.25	14.80	11.48	22.25	7.00	30.75	3.75
7*10Y	7.00	-0.50	7.85	8.73	6.77	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.25	0.00	4.10	3.89	3.88	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.25	0.00	5.95	5.66	5.46	6.25	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.25	0.00	7.95	7.62	6.61	8.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.922	2.00	1.887	1.873	1.847	1.922	1.355	2.720	1.237
1.5Y	2.096	1.50	2.068	2.060	2.020	2.096	1.350	2.820	1.232
2Y	2.212	-0.50	2.204	2.189	2.139	2.230	1.327	2.920	1.225
3Y	2.297	-0.80	2.294	2.284	2.207	2.315	1.315	3.050	1.200
4Y	2.422	-1.80	2.428	2.427	2.363	2.496	1.385	3.280	1.232
5Y	2.525	-2.20	2.536	2.537	2.451	2.602	1.335	3.410	1.217
7Y	2.656	-2.30	2.667	2.677	2.581	2.728	1.446	3.563	1.270
10Y	2.730	-2.20	2.739	2.764	2.648	2.812	1.515	3.750	1.355
20Y	2.737	-2.30	2.746	2.747	2.614	2.792	1.560	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	107.69	0.04	107.71	107.73	107.67
LKTB	119.76	0.24	119.79	119.87	119.65

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	-5.20	-2.00	-2.14	-3.16	-1.19	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-11.35	-1.25	-9.38	-10.42	-7.71	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-15.20	0.00	-14.35	-14.24	-11.75	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-13.45	0.05	-12.54	-12.09	-8.90	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-20.20	0.30	-19.38	-18.95	-18.34	-8.20	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-26.50	0.70	-25.86	-24.60	-22.83	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-34.60	0.55	-33.60	-32.57	-31.10	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-35.00	-0.05	-32.99	-32.50	-31.01	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-27.45	0.05	-25.66	-23.18	-21.00	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-41.50	6.00
-49.25	4.25
-53.50	4.50
-57.75	3.75
-57.00	4.50
-55.00	4.50
-49.00	4.75
-40.50	5.25

CRS

USD/KRW 1069.10 (-7.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.4550	6.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00
1.5Y	1.4900	4.50	1.6600	0.9100	2*3Y	2.05	0.00
2Y	1.5250	4.00	1.6950	0.8850	2*5Y	18.50	-1.00
3Y	1.5850	3.00	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	0.00
4Y	1.6500	3.00	1.8000	0.8400	3*5Y	12.50	0.00
5Y	1.7100	3.00	1.8500	0.8350	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.8200	3.00	1.8950	0.8050	5*7Y	11.00	0.00
10Y	1.9750	3.00	2.0150	0.8000	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	2.2499	-0.0081	2.2580	2.2458	2.2540	2.2661	0.7800	2.2661	0.2800
10Y	2.8836	-0.0064	2.8900	2.8835	2.8625	2.9500	1.6870	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	3.79	-0.31	4.10	3.78	4.60	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	15.36	1.56	13.80	15.85	10.75	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	32.00	-1.75	33.75	33.75	36.00	42.50	8.25	68.25	2.75
KTB 2*10Y	51.80	-1.70	53.50	51.70	54.70	68.70	17.80	89.00	11.80
UST 2*10Y	63.37	0.17	63.20	63.77	60.85	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	11Y 40.5 / 40
06M			
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	5 / 5.25	SPRD	
03Y	15.25 / 15.5		
04Y			
05Y	25.75 / 25.5		
07Y			
10Y	38 / 37.75 / 37.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	111 건	3	108	154	131	150	82	82
금 액	31,120 억원	8,132	22,988	66,840	38,275	67,305	26,660	26,660

장중동향

국고채 금리, 하락 마감.
미 금리 흐름에 연동되는 모습.

IRS, 1년을 제외한 구간에서 하락 마감. 커브 플래트닝.
북한 지정학적 위험 완화에 예상했듯이 롱이 나오긴 했지만, 생각보다 강하지 않았음.

CRS, 전반적으로 상승마감.