IPS Daily Morning Brief

2018-03-09

종가 기준일 2018-03-08

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7400	0.25	1.7375	1.7108	1.7018	1.7400	1.3250	2.6775	1.2875
9M	1.8025	-0.25	1.8070	1.7786	1.7673	1.8125	1.3125	2.7075	1.2500
1Y	1.8675	-0.25	1.8710	1.8431	1.8364	1.8850	1.3025	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9825	0.00	1.9815	1.9578	1.9445	2.0050	1.2925	2.8100	1.1900
2Y	2.0600	0.00	2.0655	2.0481	2.0240	2.1000	1.2825	2.8850	1.1675
3Y	2.1625	0.00	2.1715	2.1636	2.1210	2.2175	1.2900	3.0275	1.1550
4Y	2.2250	0.50	2.2345	2.2374	2.1827	2.2950	1.3025	3.1450	1.1575
5Y	2.2650	0.50	2.2750	2.2903	2.2261	2.3400	1.3150	3.2400	1.1575
7Y	2.3150	0.50	2.3270	2.3504	2.2735	2.3950	1.3400	3.3800	1.1675
10Y	2.3900	1.00	2.4025	2.4371	2.3416	2.4850	1.4000	3.5250	1.2125
12Y	2.4325	1.00	2.4440	2.4763	2.3804	2.5225	1.4050	3.5600	1.2150
15Y	2.4525	1.00	2.4630	2.4941	2.3964	2.5400	1.4075	3.5825	1.2150
20Y	2.4725	1.00	2.4830	2.5139	2.4083	2.5600	1.3925	3.7325	1.2150

6*9M	6.25	-0.50	6.95	6.79	6.55	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.50	0.00	6.40	6.45	6.91	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	19.25	0.25	19.45	20.50	18.76	23.00	-3.25	23.00	-5.50
2*3Y	10.25	0.00	10.60	11.55	9.70	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	16.50	0.50	16.90	18.93	15.87	21.75	1.00	27.75	-1.75
2*5Y	20.50	0.50	20.95	24.21	20.21	27.25	2.25	38.50	-1.75
3*4Y	6.25	0.50	6.30	7.38	6.17	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.50	10.35	12.66	10.51	14.00	2.25	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.00	4.05	5.29	4.35	6.25	1.25	11.25	-0.25
5*7Y	5.00	0.00	5.20	6.01	4.74	10.50	2.00	15.25	0.25
5*10Y	12.50	0.50	12.75	14.69	11.55	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.50	0.50	7.55	8.68	6.80	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.25	0.00	4.15	3.91	3.88	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.25	0.00	6.05	5.70	5.48	6.25	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.25	0.00	8.05	7.67	6.67	8.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.935	1.30	1.903	1.877	1.849	1.935	1.362	2.720	1.237
1.5Y	2.108	1.20	2.082	2.063	2.023	2.108	1.360	2.820	1.232
2Y	2.206	-0.60	2.210	2.190	2.142	2.230	1.327	2.920	1.225
3Y	2.285	-1.20	2.298	2.284	2.211	2.315	1.315	3.050	1.200
4Y	2.410	-1.20	2.428	2.426	2.366	2.496	1.385	3.280	1.232
5Y	2.515	-1.00	2.535	2.536	2.455	2.602	1.342	3.410	1.217
7Y	2.651	-0.50	2.666	2.677	2.585	2.728	1.457	3.563	1.270
10Y	2.730	0.00	2.738	2.763	2.653	2.812	1.530	3.750	1.355
20Y	2.735	-0.20	2.744	2.748	2.619	2.792	1.567	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	107.74	0.05	107.65	107.75	107.65
LKTB	119.76	0.00	119.68	119.86	119.62

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	-6.75	-1.55	-3.20	-3.36	-1.27	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-12.55	-1.20	-10.07	-10.48	-7.83	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-14.60	0.60	-14.47	-14.21	-11.81	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.25	1.20	-12.69	-12.07	-8.98	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-18.50	1.70	-19.39	-18.88	-18.35	-8.20	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-25.00	1.50	-26.02	-24.60	-22.91	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.60	1.00	-33.88	-32.65	-31.16	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-34.00	1.00	-33.59	-32.57	-31.09	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-26.25	1.20	-26.12	-23.41	-21.06	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-40.25	1.25
-46.75	2.50
-51.50	2.00
-55.75	2.00
-55.50	1.50
-53.50	1.50
-47.00	2.00
-39.00	1.50

CRS

USD/KRW 1070.20 (+1.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.4650	1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00
1.5Y	1.5150	2.50	1.6600	0.9100	2*3Y	2.05	0.00
2Y	1.5450	2.00	1.6950	0.8850	2*5Y	18.50	0.00
3Y	1.6050	2.00	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	0.00
4Y	1.6700	2.00	1.8000	0.8400	3*5Y	12.50	0.00
5Y	1.7300	2.00	1.8500	0.8350	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.8450	2.50	1.8950	0.8050	5*7Y	11.50	0.50
10Y	2.0000	2.50	2.0150	0.8000	5*10Y	27.00	0.50

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	2.2417	-0.0082	2.2499	2.2580	2.2458	2.2661	0.7800	2.2661	0.2800
10Y	2.8571	-0.0265	2.8836	2.8900	2.8835	2.9500	1.7040	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	3.57	-0.22	3.79	4.10	3.78	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	12.71	-2.65	15.36	13.80	15.85	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	33.00	1.00	32.00	33.75	33.75	42.50	10.75	68.25	2.75
KTB 2*10Y	52.40	0.60	51.80	53.50	51.70	68.70	20.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	61.54	-1.83	63.37	63.20	63.77	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	11y 40
06M			
09M			
01Y	86.5 / 86.75		
1.5Y	97.75 / 98		
02Y	06 / 6.25 / 6.5	SPRD	1*2y 19.25
03Y	16.25		2*4y 16
04Y	22		4*5y 04
05Y	26.5		
07Y			
10Y	39.5 / 40		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	109 건	-2	111	108	154	131	150	82
금 액	34,386 억원	3,266	31,120	22,988	66,840	38,275	67,305	26,660

장중동향

금일 채권 금리는 관세서명과 ECB 결과를 기다리며 보합권에서 움직임. 하락 출발한 국채선물은 오후부터 왜국인과 개인의 매수에 상승.

IRS는 단기는 보합권 장기로갈수록 소폭 상승하며 커브 스팁 마감. 선물과 연동하며 움직이던 레벨은 장 후반 전구간 비드가 우위를 보이며 마감.

CRS는 상승 마감.