IPS Daily Morning Brief

2018-03-16

종가 기준일 2018-03-15

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7225	-0.50	1.7315	1.7206	1.7047	1.7400	1.3250	2.6700	1.2875
9M	1.7800	-0.75	1.7925	1.7873	1.7705	1.8125	1.3125	2.7075	1.2500
1Y	1.8400	-0.75	1.8540	1.8503	1.8393	1.8850	1.3025	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9550	-0.75	1.9735	1.9646	1.9505	2.0050	1.2925	2.8100	1.1900
2Y	2.0425	-0.50	2.0610	2.0541	2.0332	2.1000	1.2825	2.8850	1.1675
3Y	2.1450	-0.50	2.1665	2.1670	2.1340	2.2175	1.2900	3.0275	1.1550
4Y	2.2150	-0.50	2.2345	2.2384	2.1976	2.2950	1.3050	3.1450	1.1575
5Y	2.2600	-0.50	2.2785	2.2879	2.2424	2.3400	1.3200	3.2400	1.1575
7Y	2.3100	-0.50	2.3295	2.3449	2.2917	2.3950	1.3475	3.3800	1.1675
10Y	2.3825	-0.75	2.4055	2.4281	2.3623	2.4850	1.4075	3.5250	1.2125
12Y	2.4275	-0.75	2.4500	2.4690	2.4017	2.5225	1.4125	3.5600	1.2150
15Y	2.4475	-0.75	2.4700	2.4875	2.4180	2.5400	1.4150	3.5825	1.2150
20Y	2.4675	-0.75	2.4900	2.5075	2.4317	2.5600	1.4000	3.7325	1.2150

6*9M	5.75	-0.25	6.10	6.66	6.58	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.00	0.00	6.15	6.30	6.88	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	20.25	0.25	20.70	20.39	19.38	23.00	-3.25	23.00	-5.50
2*3Y	10.25	0.00	10.55	11.29	10.08	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	17.25	0.00	17.35	18.43	16.45	21.75	1.00	27.75	-1.75
2*5Y	21.75	0.00	21.75	23.38	20.92	27.25	3.25	38.50	-1.75
3*4Y	7.00	0.00	6.80	7.14	6.36	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.50	0.00	11.20	12.09	10.84	14.00	2.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.40	4.95	4.47	6.25	1.50	11.25	-0.25
5*7Y	5.00	0.00	5.10	5.70	4.93	10.50	2.00	15.25	0.25
5*10Y	12.25	-0.25	12.70	14.03	11.99	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.25	-0.25	7.60	8.33	7.05	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.45	4.09	3.94	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.45	5.94	5.57	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.50	0.00	8.45	7.94	6.95	8.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.928	-0.20	1.928	1.892	1.856	1.935	1.365	2.720	1.237
1.5Y	2.066	-1.00	2.083	2.068	2.033	2.108	1.360	2.820	1.232
2Y	2.187	-0.30	2.201	2.195	2.154	2.230	1.331	2.920	1.225
3Y	2.267	0.00	2.285	2.286	2.228	2.315	1.315	3.050	1.200
4Y	2.453	-0.70	2.467	2.437	2.388	2.502	1.394	3.280	1.232
5Y	2.495	-1.00	2.528	2.535	2.477	2.602	1.362	3.410	1.217
7Y	2.623	-0.90	2.655	2.671	2.607	2.728	1.464	3.563	1.270
10Y	2.707	-0.40	2.733	2.753	2.677	2.812	1.537	3.750	1.355
20Y	2.676	-3.40	2.732	2.748	2.644	2.792	1.570	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	107.82	0.01	107.82	107.91	107.80
LKTB	120.05	0.08	120.06	120.28	120.02

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	-8.80	-0.55	-7.40	-4.17	-1.68	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-11.10	0.25	-10.99	-10.32	-8.21	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-14.45	-0.20	-13.98	-14.13	-12.07	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.20	-0.50	-11.83	-11.91	-9.37	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-23.80	0.20	-23.29	-19.84	-19.00	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.50	0.50	-24.99	-24.66	-23.44	-3.75	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.30	0.40	-32.55	-32.59	-31.52	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.45	-0.35	-32.79	-32.51	-31.45	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-20.85	2.65	-24.22	-24.04	-21.27	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-41.00	-1.75
-47.00	-1.75
-50.25	-1.50
-52.00	-2.00
-54.00	-2.00
-53.00	-1.50
-46.50	-1.50
-38.25	-1.25

CRS

USD/KRW 1065.40 (+0.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.4300	-2.50	1.6200	0.7650	1*2Y	11.00	0.50
1.5Y	1.4850	-2.50	1.6600	0.9100	2*3Y	8.50	-0.50
2Y	1.5400	-2.00	1.6950	0.8850	2*5Y	19.00	0.00
3Y	1.6250	-2.50	1.7550	0.8550	3*4Y	5.00	0.00
4Y	1.6750	-2.50	1.8000	0.8400	3*5Y	10.50	0.50
5Y	1.7300	-2.00	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	0.50
7Y	1.8450	-2.00	1.8950	0.8050	5*7Y	11.50	0.00
10Y	2.0000	-2.00	2.0500	0.8000	5*10Y	27.00	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	2.2908	0.0247	2.2661	2.2580	2.2661	2.2908	0.7800	2.2908	0.2800
10Y	2.8301	0.0119	2.8182	2.8447	2.8681	2.9500	1.7390	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	10.38	2.77	7.61	5.30	5.41	10.38	-70.50	10.38	-264.00
10Y	12.31	1.59	10.72	9.97	11.11	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	34.00	-0.25	34.25	35.00	35.00	42.50	11.25	68.25	2.75
KTB 2*10Y	52.00	-0.10	52.10	54.00	54.50	68.70	20.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	53.93	-1.28	55.21	58.67	60.20	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	78		
01Y	84.5 / 84		
1.5Y			
02Y	4	SPRD	6*9M 06
03Y	13.25 / 14		1*5Y 41
04Y	20		2*3Y 10
05Y	24.25 / 2.2575		5*7Y 4.75
07Y			
10Y	36.75 / 37 / 37.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1Y 1.44 / 1.43 3Y 1.62 5Y 1.715 / 1.725		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	96 건	-2	98	98	84	99	109	111
금 액	27,800 억원	1,332	26,468	30,782	18,819	28,875	34,386	31,120

장중동향

국고채 금리, 1년을 제외한 구간에서 하락.
이주열 한국은행 총재 청문회 서면 질의 답변에서 "연임에 따른 조기 금리 인상 우려가 적절하지 않다"고 언급한점과 국고채 50년물 입찰이 강세 압력으로 작용.

IRS, 금리 하락.
이주열 총재 발언이 기준금리 인상 시기를 늦추는 재료로 작용하면서 단기구간 오퍼 우세. 5년 위 테너는 비드 수요가 우위.

CRS, 오후 장 들어 비드가 나오면서 레벨 상승했지만 전반적으로 금리 하락..