

IPS Daily Morning Brief

2018-03-18

종가 기준일 2018-03-16

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7175	-0.50	1.7270	1.7219	1.7052	1.7400	1.3250	2.6700	1.2875
9M	1.7775	-0.25	1.7875	1.7883	1.7710	1.8125	1.3125	2.7075	1.2500
1Y	1.8375	-0.25	1.8485	1.8509	1.8398	1.8850	1.3025	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9550	0.00	1.9670	1.9654	1.9515	2.0050	1.2925	2.8100	1.1900
2Y	2.0425	0.00	2.0550	2.0548	2.0345	2.1000	1.2825	2.8850	1.1675
3Y	2.1500	0.50	2.1605	2.1673	2.1361	2.2175	1.2925	3.0275	1.1550
4Y	2.2200	0.50	2.2305	2.2383	2.2001	2.2950	1.3125	3.1450	1.1575
5Y	2.2650	0.50	2.2755	2.2871	2.2451	2.3400	1.3325	3.2400	1.1575
7Y	2.3125	0.25	2.3255	2.3435	2.2947	2.3950	1.3600	3.3800	1.1675
10Y	2.3875	0.50	2.4005	2.4260	2.3656	2.4850	1.4225	3.5250	1.2125
12Y	2.4325	0.50	2.4455	2.4673	2.4051	2.5225	1.4275	3.5600	1.2150
15Y	2.4525	0.50	2.4655	2.4859	2.4215	2.5400	1.4300	3.5825	1.2150
20Y	2.4725	0.50	2.4855	2.5059	2.4356	2.5600	1.4150	3.7325	1.2150

6*9M	6.00	0.25	6.05	6.64	6.59	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.00	0.00	6.10	6.26	6.87	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	20.50	0.25	20.65	20.39	19.48	23.00	-3.25	23.00	-5.50
2*3Y	10.75	0.50	10.55	11.25	10.16	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	17.75	0.50	17.55	18.35	16.55	21.75	1.00	27.75	-1.75
2*5Y	22.25	0.50	22.05	23.24	21.05	27.25	3.25	38.50	-1.75
3*4Y	7.00	0.00	7.00	7.10	6.40	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.50	0.00	11.50	11.99	10.90	14.00	2.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.50	4.89	4.50	6.25	1.75	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	-0.25	5.00	5.64	4.96	10.50	2.00	15.25	0.25
5*10Y	12.25	0.00	12.50	13.89	12.05	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.50	0.25	7.50	8.25	7.09	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.13	3.95	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	5.99	5.59	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.50	0.00	8.50	7.99	7.00	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	0.00	1.929	1.895	1.857	1.935	1.365	2.720	1.237
1.5Y	2.070	0.40	2.078	2.069	2.034	2.108	1.362	2.820	1.232
2Y	2.192	0.50	2.197	2.197	2.156	2.230	1.340	2.920	1.225
3Y	2.270	0.30	2.280	2.287	2.231	2.315	1.317	3.050	1.200
4Y	2.455	0.20	2.473	2.439	2.391	2.502	1.400	3.280	1.232
5Y	2.495	0.00	2.520	2.533	2.480	2.602	1.370	3.410	1.217
7Y	2.627	0.40	2.646	2.669	2.610	2.728	1.475	3.563	1.270
10Y	2.715	0.80	2.727	2.751	2.681	2.812	1.557	3.750	1.355
20Y	2.681	0.50	2.717	2.746	2.648	2.792	1.595	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	107.83	0.01	107.83	107.84	107.78
LKTb	119.96	-0.09	120.08	120.13	119.95

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-9.05	-0.25	-8.05	-4.41	-1.77	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-11.50	-0.40	-11.06	-10.33	-8.27	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-14.95	-0.50	-14.22	-14.19	-12.16	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.00	0.20	-11.93	-11.93	-9.48	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-23.50	0.30	-24.25	-20.09	-19.13	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.00	0.50	-24.45	-24.63	-23.51	-3.75	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.45	-0.15	-32.09	-32.56	-31.57	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.75	-0.30	-32.65	-32.54	-31.54	-13.45	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-20.85	0.00	-23.17	-24.01	-21.27	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1066.20 (+0.80)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-42.75	-1.75	1Y	1.4100	-2.00	1.6200	0.7650	1*2Y	11.50	0.50	
-48.50	-1.50	1.5Y	1.4700	-1.50	1.6600	0.9100	2*3Y	8.00	-0.50	
-51.75	-1.50	2Y	1.5250	-1.50	1.6950	0.8850	2*5Y	19.00	0.00	
-54.50	-2.50	3Y	1.6050	-2.00	1.7550	0.8550	3*4Y	5.50	0.50	
-56.00	-2.00	4Y	1.6600	-1.50	1.8000	0.8400	3*5Y	11.00	0.50	
-55.00	-2.00	5Y	1.7150	-1.50	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	0.00	
-48.25	-1.75	7Y	1.8300	-1.50	1.8950	0.8050	5*7Y	11.50	0.00	
-40.25	-2.00	10Y	1.9850	-1.50	2.0500	0.8100	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	2.2909	0.0001	2.2908	2.2661	2.2580	2.2909	0.7800	2.2909	0.2800
10Y	2.8466	0.0165	2.8301	2.8182	2.8447	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	9.89	-0.49	10.38	7.61	5.30	10.38	-70.50	10.38	-264.00
10Y	13.16	0.85	12.31	10.72	9.97	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	34.50	0.50	34.00	34.25	35.00	42.50	11.25	68.25	2.75
KTb 2*10Y	52.30	0.30	52.00	52.10	54.00	68.70	20.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	55.57	1.64	53.93	55.21	58.67	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS				ODD Tenor					
06M									
09M	77.75								
01Y	83.5 / 83.75 / 84								
1.5Y									
02Y				SPRD	5*8y	07			
03Y	15 / 15.5				5*10y	11.75 / 12.25			
04Y									
05Y	26.5 / 26.75 / 27								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	85 건	-11	96	98	98	84	99	109	
금 액	34,015 억원	6,215	27,800	26,468	30,782	18,819	28,875	34,386	

장중동향

채권금리 소폭상승. 다음주로 예정되어있는 FOMC와 한은총재 청문회, 국채선물물오버등의 여러 재료로 관망세.

IRS는 1년이하 단기를 레벨이 -0.25 ~ -0.5bp 하락하고 3년이상으로 0.5bp 상승하면서 커브 스프릿마감. 그간 계속됐던 5년 본드 스왑을 들어가는 비드가 오늘도 꾸준히 나와 5년이 비디시.

CRS는 전체적으로 하락 마감.