

IPS Daily Morning Brief

2018-03-20

종가 기준일 2018-03-19

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7200	0.25	1.7240	1.7229	1.7056	1.7400	1.3300	2.6700	1.2875
9M	1.7775	0.00	1.7835	1.7884	1.7715	1.8125	1.3175	2.7075	1.2500
1Y	1.8400	0.25	1.8445	1.8508	1.8402	1.8850	1.3100	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9525	-0.25	1.9605	1.9646	1.9523	2.0050	1.3050	2.8100	1.1900
2Y	2.0400	-0.25	2.0480	2.0536	2.0358	2.1000	1.2975	2.8850	1.1675
3Y	2.1500	0.00	2.1540	2.1656	2.1381	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.2225	0.25	2.2245	2.2361	2.2025	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.2725	0.75	2.2705	2.2846	2.2478	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.3200	0.75	2.3200	2.3403	2.2976	2.3950	1.3900	3.3800	1.1675
10Y	2.3950	0.75	2.3945	2.4220	2.3689	2.4850	1.4425	3.5250	1.2125
12Y	2.4400	0.75	2.4395	2.4636	2.4086	2.5225	1.4500	3.5600	1.2150
15Y	2.4600	0.75	2.4595	2.4824	2.4249	2.5400	1.4525	3.5825	1.2150
20Y	2.4800	0.75	2.4795	2.5024	2.4394	2.5600	1.4375	3.7325	1.2150

6*9M	5.75	-0.25	5.95	6.55	6.59	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.25	0.25	6.10	6.24	6.86	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	20.00	-0.50	20.35	20.29	19.56	23.00	-3.25	23.00	-5.50
2*3Y	11.00	0.25	10.60	11.20	10.24	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	18.25	0.50	17.65	18.25	16.67	21.75	1.00	27.75	-1.75
2*5Y	23.25	1.00	22.25	23.10	21.20	27.25	3.25	38.50	-1.75
3*4Y	7.25	0.25	7.05	7.05	6.43	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	12.25	0.75	11.65	11.90	10.97	14.00	2.75	25.00	-0.50
4*5Y	5.00	0.50	4.60	4.85	4.53	6.25	1.75	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	4.95	5.56	4.98	10.50	2.00	15.25	0.25
5*10Y	12.25	0.00	12.40	13.74	12.11	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.50	0.00	7.45	8.18	7.13	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.16	3.97	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.04	5.60	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.50	0.00	8.50	8.04	7.05	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	1.898	1.859	1.935	1.380	2.720	1.237
1.5Y	2.069	-0.10	2.073	2.069	2.036	2.108	1.385	2.820	1.232
2Y	2.192	0.00	2.193	2.196	2.158	2.230	1.365	2.920	1.225
3Y	2.275	0.50	2.275	2.285	2.234	2.315	1.346	3.050	1.200
4Y	2.462	0.70	2.465	2.440	2.395	2.502	1.445	3.280	1.232
5Y	2.500	0.50	2.508	2.530	2.484	2.602	1.422	3.410	1.217
7Y	2.633	0.60	2.637	2.665	2.614	2.728	1.527	3.563	1.270
10Y	2.725	1.00	2.721	2.748	2.685	2.812	1.597	3.750	1.355
20Y	2.707	2.60	2.705	2.743	2.653	2.792	1.655	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	0.00	107.81	107.86	107.78
LKTb	119.94	-0.02	119.88	119.96	119.77

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-8.80	0.25	-8.45	-4.68	-1.86	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-11.65	-0.15	-11.29	-10.39	-8.33	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-15.20	-0.25	-14.52	-14.23	-12.25	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.50	-0.50	-12.08	-11.95	-9.59	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-23.95	-0.45	-24.05	-20.36	-19.27	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-22.75	0.25	-23.75	-24.55	-23.57	-5.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.30	0.15	-31.68	-32.51	-31.62	-12.85	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.00	-0.25	-32.61	-32.59	-31.63	-14.25	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-22.70	-1.85	-22.53	-24.10	-21.33	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1071.60 (+5.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-43.50	-0.75	1Y	1.4050	-0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	11.50	0.00		
-48.75	-0.25	1.5Y	1.4650	-0.50	1.6600	0.9100	2*3Y	8.00	0.00		
-52.00	-0.25	2Y	1.5200	-0.50	1.6950	0.8850	2*5Y	19.00	0.00		
-55.00	-0.50	3Y	1.6000	-0.50	1.7550	0.8550	3*4Y	5.50	0.00		
-56.75	-0.75	4Y	1.6550	-0.50	1.8000	0.8400	3*5Y	11.00	0.00		
-56.25	-1.25	5Y	1.7100	-0.50	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	0.00		
-49.50	-1.25	7Y	1.8250	-0.50	1.8950	0.8050	5*7Y	11.50	0.00		
-41.50	-1.25	10Y	1.9800	-0.50	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	2.3157	0.0248	2.2909	2.2908	2.2661	2.3157	0.7800	2.3157	0.2800
10Y	2.8576	0.0110	2.8466	2.8301	2.8182	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	12.37	2.48	9.89	10.38	7.61	12.37	-70.50	12.37	-264.00
10Y	13.26	0.10	13.16	12.31	10.72	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	35.50	1.00	34.50	34.00	34.25	42.50	11.25	68.25	2.75
KTb 2*10Y	53.30	1.00	52.30	52.00	52.10	68.70	20.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	54.19	-1.38	55.57	53.93	55.21	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	71.25								
09M									
01Y	83.5 / 84								
1.5Y	96								
02Y	04				SPRD	2*3Y		11	
03Y	15					10*12Y		4.5	
04Y									
05Y	27 / 27.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	86 건	1	85	96	98	98	84	99	
금 액	37,335 억원	3,320	34,015	27,800	26,468	30,782	18,819	28,875	

장종동향

국고채 금리, 대부분 구간에서 상승.

국고 10년물 입찰 호조. 1조 8천억원 2.73% 낙찰. 장투기관 수요 유입.

IRS, 일부 테너 제외하고 보험권 금리 보험권 마감.

장 초반 본드스왑 포지션 관련 비드가 강하게 들어왔지만, 오후들어 오퍼리시.

CRS, FOMC를 앞두고 관망세가 짙어 금리 약간 하락하며 마감.