

IPS Daily Morning Brief

2018-03-21

종가 기준일 2018-03-20

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7225	0.25	1.7220	1.7239	1.7060	1.7400	1.3300	2.6700	1.2875
9M	1.7825	0.50	1.7810	1.7886	1.7720	1.8125	1.3175	2.7075	1.2500
1Y	1.8475	0.75	1.8425	1.8510	1.8405	1.8850	1.3100	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9575	0.50	1.9565	1.9639	1.9529	2.0050	1.3050	2.8100	1.1900
2Y	2.0450	0.50	2.0435	2.0523	2.0366	2.1000	1.2975	2.8850	1.1675
3Y	2.1575	0.75	2.1505	2.1638	2.1398	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.2275	0.50	2.2210	2.2338	2.2046	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.2750	0.25	2.2675	2.2818	2.2501	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.3225	0.25	2.3160	2.3366	2.3003	2.3950	1.3900	3.3800	1.1675
10Y	2.3950	0.00	2.3900	2.4175	2.3720	2.4850	1.4425	3.5250	1.2125
12Y	2.4400	0.00	2.4350	2.4595	2.4118	2.5225	1.4500	3.5600	1.2150
15Y	2.4600	0.00	2.4550	2.4784	2.4282	2.5400	1.4525	3.5825	1.2150
20Y	2.4800	0.00	2.4750	2.4984	2.4431	2.5600	1.4375	3.7325	1.2150

6*9M	6.00	0.25	5.90	6.48	6.60	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.50	0.25	6.15	6.24	6.85	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	19.75	-0.25	20.10	20.13	19.60	23.00	-3.25	23.00	-5.50
2*3Y	11.25	0.25	10.70	11.15	10.32	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	18.25	0.00	17.75	18.15	16.80	21.75	1.00	27.75	-1.75
2*5Y	23.00	-0.25	22.40	22.95	21.35	27.25	3.25	38.50	-1.75
3*4Y	7.00	-0.25	7.05	7.00	6.48	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.75	-0.50	11.70	11.80	11.04	14.00	2.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	-0.25	4.65	4.80	4.55	6.25	1.75	11.25	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	4.85	5.49	5.02	10.50	2.00	15.25	0.25
5*10Y	12.00	-0.25	12.25	13.58	12.19	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.25	-0.25	7.40	8.09	7.17	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.20	3.98	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.09	5.62	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.50	0.00	8.50	8.09	7.11	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	1.928	1.899	1.860	1.935	1.380	2.720	1.237
1.5Y	2.069	0.00	2.070	2.068	2.037	2.108	1.385	2.820	1.232
2Y	2.192	0.00	2.191	2.195	2.160	2.230	1.365	2.920	1.225
3Y	2.285	1.00	2.273	2.284	2.237	2.315	1.346	3.050	1.200
4Y	2.472	1.00	2.460	2.440	2.399	2.502	1.445	3.280	1.232
5Y	2.512	1.20	2.501	2.527	2.487	2.602	1.422	3.410	1.217
7Y	2.642	0.90	2.631	2.662	2.617	2.728	1.527	3.563	1.270
10Y	2.732	0.70	2.718	2.744	2.689	2.812	1.597	3.750	1.355
20Y	2.705	-0.20	2.696	2.740	2.657	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	107.39	-0.44	107.42	107.46	107.35
LKTb	119.40	-0.54	119.46	119.52	119.33

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	-8.05	0.75	-8.59	-4.84	-1.93	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-11.15	0.50	-11.35	-10.41	-8.38	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-14.70	0.50	-14.71	-14.24	-12.32	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.75	-0.25	-12.23	-11.99	-9.70	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-24.45	-0.50	-23.94	-20.66	-19.40	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.70	-0.95	-23.39	-24.51	-23.64	-5.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.95	-0.65	-31.54	-32.49	-31.67	-13.20	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.70	-0.70	-32.80	-32.65	-31.73	-14.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-22.50	0.20	-22.08	-24.14	-21.41	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1068.60 (-3.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-47.75	-4.25	1Y	1.3700	-3.50	1.6200	0.7650	1*2Y	11.50	0.00		
-53.25	-4.50	1.5Y	1.4250	-4.00	1.6600	0.9100	2*3Y	8.50	0.50		
-56.00	-4.00	2Y	1.4850	-3.50	1.6950	0.8850	2*5Y	19.50	0.50		
-58.75	-3.75	3Y	1.5700	-3.00	1.7550	0.8550	3*4Y	5.50	0.00		
-60.25	-3.50	4Y	1.6250	-3.00	1.8000	0.8400	3*5Y	11.00	0.00		
-59.50	-3.25	5Y	1.6800	-3.00	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	0.00		
-52.25	-2.75	7Y	1.8000	-2.50	1.8950	0.8050	5*7Y	12.00	0.50		
-43.50	-2.00	10Y	1.9600	-2.00	2.0500	0.8100	5*10Y	28.00	1.00		

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	2.3489	0.0332	2.3157	2.2909	2.2908	2.3489	0.7800	2.3489	0.2800
10Y	2.8971	0.0395	2.8576	2.8466	2.8301	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	15.69	3.32	12.37	9.89	10.38	15.69	-70.50	15.69	-264.00
10Y	16.51	3.25	13.26	13.16	12.31	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	35.00	-0.50	35.50	34.50	34.00	42.50	11.25	68.25	2.75
KTb 2*10Y	54.00	0.70	53.30	52.30	52.00	68.70	20.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	54.82	0.63	54.19	55.57	53.93	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	84.25 / 84.75								
1.5Y									
02Y	04 / 4.5 / 4.75	SPRD	3*12Y 28.25						
03Y	15.25 / 15.5		3*5Y 11.75 / 12						
04Y	22.25								
05Y	27 / 27.75								
07Y	32.25								
10Y	39 / 38.75								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y 1.37								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	91 건	5	86	85	96	98	98	84	
금 액	22,375 억원	-14,960	37,335	34,015	27,800	26,468	30,782	18,819	

장중동향
국고채 금리, 대부분 구간에서 소폭 상승.
미 국채금리가 상승한 가운데 이주열 한국은행 총재 인사청문회와 FOMC 등 대내외 이벤트를 앞두고 관망세.

IRS 금리, 10년 제외 구간 상승 마감.
3년과 5년 구간을 중심으로 비드 수요 우위.

CRS 금리, 하락 마감.