IPS Daily Morning Brief

2018-03-22

종가 기준일 2018-03-21

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7150	-0.75	1.7195	1.7245	1.7063	1.7400	1.3300	2.6700	1.2875
9M	1.7825	0.00	1.7800	1.7890	1.7725	1.8125	1.3175	2.7075	1.2500
1Y	1.8500	0.25	1.8430	1.8515	1.8409	1.8850	1.3125	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9575	0.00	1.9555	1.9633	1.9534	2.0050	1.3075	2.8100	1.1900
2Y	2.0450	0.00	2.0430	2.0513	2.0374	2.1000	1.2975	2.8850	1.1675
3Y	2.1600	0.25	2.1525	2.1623	2.1413	2.2175	1.3000	3.0275	1.1550
4Y	2.2300	0.25	2.2230	2.2318	2.2067	2.2950	1.3225	3.1450	1.1575
5Y	2.2750	0.00	2.2695	2.2791	2.2524	2.3400	1.3475	3.2400	1.1575
7Y	2.3250	0.25	2.3180	2.3334	2.3029	2.3950	1.3900	3.3800	1.1675
10Y	2.3925	-0.25	2.3905	2.4131	2.3749	2.4850	1.4425	3.5250	1.2125
12Y	2.4375	-0.25	2.4355	2.4555	2.4149	2.5225	1.4500	3.5600	1.2150
15Y	2.4575	-0.25	2.4555	2.4745	2.4314	2.5400	1.4525	3.5825	1.2150
20Y	2.4475	-3.25	2.4695	2.4930	2.4461	2.5600	1.4375	3.7325	1.2150

6*9M	6.75	0.75	6.05	6.45	6.62	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.75	0.25	6.30	6.25	6.84	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	19.50	-0.25	20.00	19.98	19.65	23.00	-3.25	23.00	-5.50
2*3Y	11.50	0.25	10.95	11.10	10.40	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	18.50	0.25	18.00	18.05	16.93	21.75	1.00	27.75	-1.75
2*5Y	23.00	0.00	22.65	22.79	21.50	27.25	3.25	38.50	-1.75
3*4Y	7.00	0.00	7.05	6.95	6.53	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.50	-0.25	11.70	11.69	11.11	14.00	2.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	-0.25	4.65	4.74	4.57	6.25	1.75	11.25	-0.25
5*7Y	5.00	0.25	4.85	5.43	5.05	10.50	2.00	15.25	0.25
5*10Y	11.75	-0.25	12.10	13.40	12.25	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	-0.50	7.25	7.98	7.20	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.50	4.24	4.00	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.00	6.50	6.14	5.65	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.50	-3.00	7.90	7.99	7.12	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	1.902	1.861	1.935	1.385	2.720	1.237
1.5Y	2.065	-0.40	2.068	2.067	2.038	2.108	1.387	2.820	1.232
2Y	2.190	-0.20	2.191	2.194	2.161	2.230	1.370	2.920	1.225
3Y	2.287	0.20	2.277	2.283	2.239	2.315	1.350	3.050	1.200
4Y	2.472	0.00	2.463	2.441	2.402	2.502	1.447	3.280	1.232
5Y	2.510	-0.20	2.502	2.524	2.489	2.602	1.422	3.410	1.217
7Y	2.636	-0.60	2.632	2.658	2.620	2.728	1.527	3.563	1.270
10Y	2.722	-1.00	2.720	2.740	2.693	2.812	1.597	3.750	1.355
20Y	2.695	-1.00	2.693	2.736	2.661	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	107.41	0.02	107.37	107.46	107.36
LKTB	119.48	0.08	119.30	119.56	119.26

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	-7.80	0.25	-8.50	-5.00	-1.99	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-10.75	0.40	-11.23	-10.42	-8.41	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-14.50	0.20	-14.76	-14.24	-12.38	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.70	0.05	-12.43	-12.03	-9.81	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-24.20	0.25	-23.98	-20.96	-19.51	-8.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.50	0.20	-23.29	-24.50	-23.71	-5.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.10	0.85	-31.42	-32.45	-31.72	-13.20	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.95	0.75	-32.97	-32.68	-31.82	-14.70	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.75	-2.25	-22.33	-24.29	-21.52	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-53.00	-5.25
-57.75	-4.50
-60.50	-4.50
-63.00	-4.25
-64.50	-4.25
-63.50	-4.00
-56.50	-4.25
-47.25	-3.75

CRS

USD/KRW 1072.30 (+3.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3200	-5.00	1.6200	0.7650	1*2Y	12.00	0.50
1.5Y	1.3800	-4.50	1.6600	0.9100	2*3Y	9.00	0.50
2Y	1.4400	-4.50	1.6950	0.8850	2*5Y	20.00	0.50
3Y	1.5300	-4.00	1.7550	0.8550	3*4Y	5.50	0.00
4Y	1.5850	-4.00	1.8000	0.8400	3*5Y	11.00	0.00
5Y	1.6400	-4.00	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	0.00
7Y	1.7600	-4.00	1.8950	0.8050	5*7Y	12.00	0.00
10Y	1.9200	-4.00	2.0500	0.8100	5*10Y	28.00	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	2.2993	-0.0496	2.3489	2.3157	2.2909	2.3489	0.7800	2.3489	0.2800
10Y	2.8833	-0.0138	2.8971	2.8576	2.8466	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	10.93	-4.76	15.69	12.37	9.89	15.69	-70.50	15.69	-264.00
10Y	16.13	-0.38	16.51	13.26	13.16	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	34.75	-0.25	35.00	35.50	34.50	42.50	11.25	68.25	2.75
KTB 2*10Y	53.20	-0.80	54.00	53.30	52.30	68.70	20.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	58.40	3.58	54.82	54.19	55.57	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			2.5y 10.5 / 10.75
06M	71.5	ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	95.5 / 95.75 / 96		
02Y	04 / 4.25	SPRD	6m*1.5y 24.25
03Y	15.25 / 15.75 / 16		2*3y 11.25
04Y			3*4y 07
05Y	28 / 28.5		
07Y	33.5		2*3*4y fly 4.25
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	88 건	-3	91	86	85	96	98	98
금 액	30,520 억원	8,145	22,375	37,335	34,015	27,800	26,468	30,782

장중동향

미금리 상승으로 약세 출발한 국채선물은 외국인의 매수와 전일 금통위 의사록의 비둘기적 해석으로 상승전향해 강보합. FOMC 결과를 기다리며 짙은 관망세. 장기물이 강세를 보이며 커브 플래트닝.

IRS 역시 FOMC 결과를 앞두고 눈치보는 분위기 금리는 혼조. 장중 오퍼리시한 분위기였으나, 장막판 비드가 나와 레벨을 올림.

CRS는 4~5bp 큰폭으로 하락 마감.