IPS Daily Morning Brief

2018-03-13

종가 기준일 2018-03-12

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7350	-0.50	1.7380	1.7150	1.7032	1.7400	1.3250	2.6775	1.2875
9M	1.7975	-0.50	1.8025	1.7825	1.7690	1.8125	1.3125	2.7075	1.2500
1Y	1.8600	-0.50	1.8665	1.8465	1.8381	1.8850	1.3025	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9850	-0.25	1.9835	1.9609	1.9477	2.0050	1.2925	2.8100	1.1900
2Y	2.0750	0.25	2.0665	2.0509	2.0285	2.1000	1.2825	2.8850	1.1675
3Y	2.1825	0.25	2.1715	2.1654	2.1270	2.2175	1.2900	3.0275	1.1550
4Y	2.2525	1.25	2.2345	2.2380	2.1893	2.2950	1.3050	3.1450	1.1575
5Y	2.2975	1.75	2.2755	2.2895	2.2330	2.3400	1.3200	3.2400	1.1575
7Y	2.3475	1.50	2.3265	2.3483	2.2812	2.3950	1.3475	3.3800	1.1675
10Y	2.4250	1.25	2.4020	2.4339	2.3503	2.4850	1.4075	3.5250	1.2125
12Y	2.4700	1.50	2.4450	2.4736	2.3893	2.5225	1.4125	3.5600	1.2150
15Y	2.4900	1.50	2.4650	2.4918	2.4055	2.5400	1.4150	3.5825	1.2150
20Y	2.5100	1.50	2.4850	2.5118	2.4181	2.5600	1.4000	3.7325	1.2150
6*9M	6.25	0.00	6.45	6.75	6.58	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.25	0.00	6.40	6.40	6.91	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	21.50	0.75	20.00	20.44	19.04	23.00	-3.25	23.00	-5.50
2*3Y	10.75	0.00	10.50	11.45	9.85	13.25	0.00	14.25	-1.75
2*4Y	17.75	1.00	16.80	18.71	16.08	21.75	1.00	27.75	-1.75
2*5Y	22.25	1.50	20.90	23.86	20.45	27.25	3.25	38.50	-1.75
3*4Y	7.00	1.00	6.30	7.26	6.23	8.50	0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.50	1.50	10.40	12.41	10.60	14.00	2.75	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.50	4.10	5.15	4.37	6.25	1.50	11.25	-0.25
5*7Y	5.00	-0.25	5.10	5.88	4.82	10.50	2.00	15.25	0.25
5*10Y	12.75	-0.50	12.65	14.44	11.73	22.25	7.25	30.75	3.75
7*10Y	7.75	-0.25	7.55	8.56	6.91	12.75	4.25	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.25	4.30	3.98	3.90	4.50	0.50	7.75	-0.25
10*15Y	6.50	0.25	6.30	5.79	5.52	6.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	8.50	0.25	8.30	7.79	6.78	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	0.50	1.922	1.882	1.853	1.935	1.365	2.720	1.237
1.5Y	2.090	-0.90	2.095	2.065	2.028	2.108	1.360	2.820	1.232
2Y	2.212	0.20	2.211	2.192	2.147	2.230	1.331	2.920	1.225
3Y	2.300	0.50	2.296	2.284	2.218	2.315	1.315	3.050	1.200
4Y	2.502	7.50	2.440	2.428	2.375	2.502	1.394	3.280	1.232
5Y	2.560	2.30	2.537	2.536	2.465	2.602	1.362	3.410	1.217
7Y	2.681	1.10	2.667	2.675	2.594	2.728	1.464	3.563	1.270
10Y	2.757	1.00	2.743	2.759	2.662	2.812	1.537	3.750	1.355
20Y	2.769	1.30	2.751	2.750	2.630	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	107.69	0.01	107.70	107.70	107.67
LKTB	119.54	-0.02	119.60	119.60	119.44

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	-6.80	-1.00	-5.55	-3.60	-1.44	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-10.50	0.65	-11.13	-10.38	-8.01	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.70	0.05	-14.49	-14.08	-11.89	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.75	-0.25	-12.49	-11.91	-9.11	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-24.95	-6.25	-20.57	-19.05	-18.54	-8.20	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-26.25	-0.55	-26.13	-24.64	-23.15	-3.75	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.35	0.40	-34.09	-32.67	-31.32	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.20	0.25	-34.12	-32.52	-31.22	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-25.90	0.20	-26.64	-23.81	-21.15	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-38.50	0.50
-46.00	0.25
-51.00	-0.25
-52.75	1.25
-53.25	0.25
-51.75	-0.25
-45.25	0.00
-37.50	0.25

CRS

USD/KRW 1065.20 (-4.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.4750	0.00	1.6200	0.7650	1*2Y	9.00	0.00
1.5Y	1.5250	0.00	1.6600	0.9100	2*3Y	9.00	1.50
2Y	1.5650	0.00	1.6950	0.8850	2*5Y	21.50	1.50
3Y	1.6550	1.50	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	0.00
4Y	1.7200	1.50	1.8000	0.8400	3*5Y	12.50	0.00
5Y	1.7800	1.50	1.8500	0.8350	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.8950	1.50	1.8950	0.8050	5*7Y	11.50	0.00
10Y	2.0500	1.50	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	2.2661	0.0041	2.2620	2.2417	2.2499	2.2661	0.7800	2.2661	0.2800
10Y	2.8681	-0.0257	2.8938	2.8571	2.8836	2.9500	1.7200	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	5.41	0.21	5.20	3.57	3.79	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	11.11	-3.57	14.68	12.71	15.36	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	1.00	34.00	33.00	32.00	42.50	11.25	68.25	2.75
KTB 2*10Y	54.50	0.80	53.70	52.40	51.80	68.70	20.00	89.00	11.80
UST 2*10Y	60.20	-2.98	63.18	61.54	63.37	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	7.75	SPRD	10*15Y 6.5
03Y			5*7Y 5.25 / 05
04Y	25.25		1*2Y 21.5
05Y	29		1.5*5Y 31.75
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	84 건	-15	99	109	111	108	154	131
금 액	18,819 억원	-10,056	28,875	34,386	31,120	22,988	66,840	38,275

장중동향

국고채, 금리 상승.
국고채 입찰 등 수급에 주목하는 가운데 박스권 움직임.

IRS, 1년이하 테너를 제외한 구간에서 상승.
특히 5년 구간이 비디쉬.

CRS, 3년 이상 구간에서 상승.