IPS Daily Morning Brief

2018-02-12

종가 기준일 2018-02-09

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6925	0.25	1.6870	1.6950	1.6819	1.7200	1.2925	2.6800	1.2875
9M	1.7575	0.00	1.7525	1.7646	1.7497	1.8025	1.2750	2.7075	1.2500
1Y	1.8250	0.00	1.8185	1.8396	1.8210	1.8850	1.2625	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9475	0.25	1.9390	1.9578	1.9197	2.0050	1.2500	2.8100	1.1900
2Y	2.0375	0.25	2.0280	2.0414	1.9898	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1525	0.25	2.1470	2.1469	2.0758	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2250	0.25	2.2240	2.2143	2.1315	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.2800	0.50	2.2765	2.2590	2.1693	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3425	0.50	2.3410	2.3091	2.2092	2.3925	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4275	0.50	2.4225	2.3770	2.2680	2.4725	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.4650	0.50	2.4600	2.4164	2.3064	2.5100	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.4825	0.50	2.4775	2.4320	2.3188	2.5275	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5000	0.50	2.4950	2.4486	2.3233	2.5450	1.2625	3.7325	1.2150
6*9M	6.50	-0.25	6.55	6.96	6.78	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.75	0.00	6.60	7.50	7.13	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	21.25	0.25	20.95	20.18	16.89	22.75	-3.75	22.75	-5.50
2*3Y	11.50	0.00	11.90	10.55	8.60	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	18.75	0.00	19.60	17.29	14.17	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	24.25	0.25	24.85	21.76	17.95	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	7.25	0.00	7.70	6.74	5.57	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	12.75	0.25	12.95	11.21	9.35	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.50	0.25	5.25	4.47	3.78	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.25	0.00	6.45	5.01	3.98	10.50	0.75	15.25	0.25
5*10Y	14.75	0.00	14.60	11.80	9.87	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	8.50	0.00	8.15	6.79	5.88	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.94	3.84	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.50	5.50	5.08	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.25	0.00	7.25	7.16	5.53	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.861	0.90	1.849	1.836	1.835	1.885	1.297	2.720	1.237
1.5Y	2.068	0.90	2.044	2.023	1.999	2.068	1.302	2.820	1.232
2Y	2.190	0.30	2.177	2.161	2.106	2.230	1.295	2.920	1.225
3Y	2.287	1.00	2.271	2.238	2.159	2.306	1.250	3.050	1.200
4Y	2.429	0.80	2.420	2.407	2.318	2.496	1.310	3.280	1.232
5Y	2.535	1.00	2.524	2.503	2.386	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.675	1.80	2.664	2.633	2.514	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.767	1.90	2.761	2.706	2.572	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.730	2.00	2.721	2.646	2.535	2.757	1.457	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	107.55	-0.03	107.62	107.64	107.55
LKTB	119.22	-0.18	119.50	119.56	119.22

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	-3.60	-0.90	-3.03	0.33	-1.41	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-12.05	-0.65	-10.46	-6.55	-7.97	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-15.25	-0.05	-14.86	-11.91	-11.59	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-13.45	-0.75	-12.42	-9.10	-8.35	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-20.40	-0.55	-19.60	-19.29	-18.60	-6.90	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-25.50	-0.50	-24.73	-24.39	-21.64	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.25	-1.30	-32.30	-32.42	-30.46	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.95	-1.40	-33.81	-32.87	-30.40	-12.95	-38.70	-6.50	-38.70
20Y	-23.00	-1.50	-22.62	-19.69	-21.21	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-54.50	-5.00
-60.25	-3.75
-62.25	-3.75
-65.25	-3.75
-66.00	-3.75
-66.50	-4.00
-62.25	-4.00
-56.75	-4.00

CRS

USD/KRW 1092.10 (+4.20)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2800	-5.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00
1.5Y	1.3450	-3.50	1.6600	0.9150	2*3Y	2.05	0.00
2Y	1.4150	-3.50	1.6950	0.8850	2*5Y	20.00	0.00
3Y	1.5000	-3.50	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	0.00
4Y	1.5650	-3.50	1.8000	0.8400	3*5Y	11.50	0.00
5Y	1.6150	-3.50	1.8500	0.8350	4*5Y	5.00	0.00
7Y	1.7200	-3.50	1.8950	0.8050	5*7Y	10.50	0.00
10Y	1.8600	-3.50	2.0150	0.7900	5*10Y	24.50	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	2.0650	-0.0404	2.1054	2.1256	2.1133	2.1649	0.7300	2.1649	0.2800
10Y	2.8557	0.0273	2.8284	2.8372	2.8029	2.8557	1.5300	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	-12.50	-4.34	-8.16	-3.14	-4.87	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	8.87	0.83	8.04	12.52	3.89	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	39.00	0.25	38.75	37.00	40.00	42.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	57.70	1.60	56.10	55.50	60.20	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	79.07	6.77	72.30	71.16	68.96	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	3.5 / 2.5 / 3.25 / 03	SPRD	2*5Y 24.25
03Y	14.75 / 14.5 / 14.25		2*3Y 11.25
04Y	21.75 / 22 / 22.5		
05Y	26.75 / 27.25 / 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	168 건	-26	194	136	162	130	133	175
금 액	62,328 억원	2,578	59,750	32,260	45,602	30,285	31,390	66,829

장중동향

국고채 금리, 장중 변동성 끝에 상승.

IRS, 미국 증시 급락에 영향을 받아 1년을 제외한 구간에서 상승. 커브는 살짝 스티프닝.

CRS, 에셋거래로 하락 마감.