IPS Daily Morning Brief

2018-02-19

종가 기준일 2018-02-16

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6925	0.75	1.6905	1.6929	1.6887	1.7200	1.3025	2.6800	1.2875
9M	1.7575	0.50	1.7570	1.7603	1.7533	1.8025	1.2850	2.7075	1.2500
1Y	1.8250	0.50	1.8245	1.8323	1.8228	1.8850	1.2700	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9400	0.00	1.9445	1.9520	1.9238	2.0050	1.2550	2.8100	1.1900
2Y	2.0300	-0.25	2.0360	2.0394	1.9953	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1450	-0.25	2.1520	2.1511	2.0837	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2225	-0.50	2.2310	2.2249	2.1412	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.2800	-0.75	2.2895	2.2748	2.1810	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3400	-1.50	2.3540	2.3325	2.2232	2.3925	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4300	-1.50	2.4450	2.4088	2.2850	2.4750	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.4675	-1.50	2.4825	2.4464	2.3233	2.5125	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.4850	-1.50	2.5000	2.4626	2.3368	2.5300	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5050	-1.50	2.5195	2.4806	2.3433	2.5475	1.2625	3.7325	1.2150

6*9M	6.50	-0.25	6.65	6.74	6.46	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.75	0.00	6.75	7.20	6.95	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	20.50	-0.75	21.15	20.71	17.25	22.75	-3.75	22.75	-5.50
2*3Y	11.50	0.00	11.60	11.18	8.84	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	19.25	-0.25	19.50	18.55	14.59	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	25.00	-0.50	25.35	23.54	18.58	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	7.75	-0.25	7.90	7.38	5.75	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	13.50	-0.50	13.75	12.36	9.74	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.75	-0.25	5.85	4.99	3.99	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.00	-0.75	6.45	5.78	4.22	10.50	1.00	15.25	0.25
5*10Y	15.00	-0.75	15.55	13.40	10.40	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	9.00	0.00	9.10	7.63	6.18	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.76	3.83	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.50	5.39	5.17	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.50	0.00	7.45	7.19	5.83	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.867	0.20	1.868	1.844	1.839	1.885	1.335	2.720	1.237
1.5Y	2.054	-0.20	2.060	2.033	2.003	2.079	1.319	2.820	1.232
2Y	2.168	-0.40	2.176	2.171	2.110	2.230	1.297	2.920	1.225
3Y	2.262	-1.00	2.275	2.256	2.168	2.306	1.250	3.050	1.200
4Y	2.408	-1.70	2.424	2.420	2.326	2.496	1.312	3.280	1.232
5Y	2.516	-2.40	2.536	2.523	2.400	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.661	-2.30	2.681	2.658	2.529	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.752	-2.50	2.774	2.740	2.590	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.720	-1.40	2.733	2.686	2.550	2.759	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	107.64	0.04	107.60	107.67	107.57
LKTB	119.39	0.24	119.15	119.47	119.11

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	-4.20	0.30	-4.33	-1.17	-1.58	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-11.40	0.20	-11.53	-8.12	-7.94	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.80	0.15	-14.04	-13.11	-11.46	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.70	0.75	-12.26	-10.49	-8.46	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-18.55	1.20	-19.30	-19.49	-18.46	-7.95	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.60	1.65	-24.67	-24.86	-21.86	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.10	0.80	-32.70	-32.51	-30.55	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.20	1.00	-32.90	-33.10	-30.52	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-21.50	-0.10	-21.39	-20.49	-20.69	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-54.50	0.50
-60.00	0.50
-63.00	0.75
-65.00	0.25
-65.75	0.00
-66.50	-0.25
-62.00	0.50
-56.00	0.50

CRS

USD/KRW 1077.20 (0.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2800	1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00
1.5Y	1.3400	0.50	1.6600	0.9150	2*3Y	2.05	0.00
2Y	1.4000	0.50	1.6950	0.8850	2*5Y	21.50	-1.50
3Y	1.4950	0.00	1.7550	0.8550	3*4Y	7.00	-0.50
4Y	1.5650	-0.50	1.8000	0.8400	3*5Y	12.00	-1.00
5Y	1.6150	-1.00	1.8500	0.8350	4*5Y	5.00	-0.50
7Y	1.7200	-1.00	1.8950	0.8050	5*7Y	10.50	0.00
10Y	1.8700	-1.00	2.0150	0.7900	5*10Y	25.50	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	2.1936	0.0051	2.1885	2.1677	2.1143	2.1936	0.7400	2.1936	0.2800
10Y	2.8786	-0.0309	2.9095	2.9058	2.8294	2.9095	1.5600	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	2.56	0.91	1.65	-0.03	-5.77	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	12.66	-0.59	13.25	15.38	5.24	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	40.00	-1.25	41.25	40.00	41.25	42.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	58.40	-2.10	60.50	58.40	60.50	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	68.50	-3.60	72.10	73.81	71.51	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	82 / 82.25		
1.5Y			
02Y	03	SPRD	9*12M 6.75
03Y	14 / 15 / 15.25		6*12Y 19.25
04Y			7*10Y 8.5
05Y	28.5		7*12Y 12.75
07Y			7*20Y 16.5
10Y	43.5		
12Y	46.25		
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	88 건	-67	155	88	155	142	168	194
금 액	23,240 억원	-10,243	33,483	23,240	33,483	38,152	62,328	59,750

장중동향

국고채 금리, 미 소비자물가 부진 전망에 엔화 강세, 미국채 하락 등 안전자산 선호가 부각되면서 금리 하락 마감.
외인이 3년 국채선물을 순매수 한것도 국고채 가격 강세 재료.

IRS, 1년을 제외한 구간에서 금리 하락. 커브 플래트닝.
현물에 비해 약한 분위기. 양방향 호가가 모두 많았음.

CRS, 2Y 이하 구간 금리 상승, 4Y 이상 구간 금리 하락.