IPS Daily Morning Brief

2018-02-13

종가 기준일 2018-02-12

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6975	0.50	1.6875	1.6939	1.6833	1.7200	1.2925	2.6800	1.2875
9M	1.7650	0.75	1.7535	1.7628	1.7503	1.8025	1.2750	2.7075	1.2500
1Y	1.8325	0.75	1.8195	1.8370	1.8212	1.8850	1.2625	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9625	1.50	1.9405	1.9556	1.9205	2.0050	1.2500	2.8100	1.1900
2Y	2.0550	1.75	2.0295	2.0400	1.9907	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1750	2.25	2.1460	2.1468	2.0773	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2550	3.00	2.2220	2.2155	2.1334	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.3125	3.25	2.2750	2.2614	2.1717	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3800	3.75	2.3385	2.3134	2.2121	2.3925	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4750	4.75	2.4230	2.3833	2.2716	2.4750	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.5125	4.75	2.4605	2.4223	2.3100	2.5125	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.5300	4.75	2.4780	2.4380	2.3226	2.5300	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5475	4.75	2.4955	2.4550	2.3275	2.5475	1.2625	3.7325	1.2150

6*9M	6.75	0.25	6.60	6.89	6.70	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.75	0.00	6.60	7.43	7.09	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	22.25	1.00	21.00	20.30	16.95	22.75	-3.75	22.75	-5.50
2*3Y	12.00	0.50	11.65	10.68	8.66	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	20.00	1.25	19.25	17.55	14.27	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	25.75	1.50	24.55	22.14	18.10	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	8.00	0.75	7.60	6.88	5.61	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	13.75	1.00	12.90	11.46	9.44	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.75	0.25	5.30	4.59	3.83	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.75	0.50	6.35	5.20	4.04	10.50	0.75	15.25	0.25
5*10Y	16.25	1.50	14.80	12.19	9.99	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	9.50	1.00	8.45	6.99	5.95	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.90	3.84	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.50	5.48	5.10	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.25	0.00	7.25	7.18	5.59	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.875	1.40	1.854	1.837	1.836	1.885	1.297	2.720	1.237
1.5Y	2.079	1.10	2.053	2.025	2.000	2.079	1.302	2.820	1.232
2Y	2.202	1.20	2.180	2.162	2.107	2.230	1.295	2.920	1.225
3Y	2.305	1.80	2.274	2.242	2.161	2.306	1.250	3.050	1.200
4Y	2.454	2.50	2.420	2.410	2.319	2.496	1.310	3.280	1.232
5Y	2.569	3.40	2.525	2.507	2.389	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.715	4.00	2.665	2.639	2.517	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.812	4.50	2.761	2.713	2.576	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.759	2.90	2.722	2.655	2.538	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	107.47	-0.08	107.55	107.56	107.47
LKTB	118.80	-0.42	119.10	119.14	118.78

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	-4.25	-0.65	-3.45	-0.05	-1.47	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-11.65	0.40	-11.29	-6.96	-7.99	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-14.70	0.55	-15.01	-12.21	-11.58	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-13.00	0.45	-12.82	-9.49	-8.39	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-19.90	0.50	-19.76	-19.40	-18.60	-7.00	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-25.65	-0.15	-25.02	-24.57	-21.70	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.50	-0.25	-32.67	-32.51	-30.49	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.70	0.25	-33.76	-33.00	-30.43	-12.95	-38.70	-7.00	-38.70
20Y	-21.15	1.85	-22.61	-19.98	-21.10	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-55.75	-1.25
-62.25	-2.00
-64.00	-1.75
-66.50	-1.25
-67.50	-1.50
-68.25	-1.75
-64.50	-2.25
-59.00	-2.25

CRS

USD/KRW 1084.60 (-7.50)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2750	-0.50	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	1.4150	0.00	1.6950	0.8850	2*5Y	21.50	1.50
3Y	1.5100	1.00	1.7550	0.8550	3*4Y	7.00	0.50
4Y	1.5800	1.50	1.8000	0.8400	3*5Y	12.00	0.50
5Y	1.6300	1.50	1.8500	0.8350	4*5Y	5.00	0.00
7Y	1.7350	1.50	1.8950	0.8050	5*7Y	10.50	0.00
10Y	1.8850	2.50	2.0150	0.7900	5*10Y	25.50	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	2.0814	0.0164	2.0650	2.1054	2.1256	2.1649	0.7300	2.1649	0.2800
10Y	2.8602	0.0045	2.8557	2.8284	2.8372	2.8602	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	-12.06	0.44	-12.50	-8.16	-3.14	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	4.82	-4.05	8.87	8.04	12.52	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	42.00	3.00	39.00	38.75	37.00	42.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	61.00	3.30	57.70	56.10	55.50	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	77.88	-1.19	79.07	72.30	71.16	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	95.25 / 95.5		
02Y		SPRD	2*5Y 25.5 / 25.75
03Y	16.25 / 17		2*9Y 38
04Y			2*10Y 40
05Y	29.25		7*10Y 9.25
07Y			
10Y	44.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	142 건	-26	168	194	136	162	130	133
금 액	38,152 억원	-24,176	62,328	59,750	32,260	45,602	30,285	31,390

장중동향

국고채 금리, 상승 마감.
오전 약세로 출발해 큰 움직임을 보이지 않음. 국고 5년물 1조5500억이 선매출 2.55%, 본매출 2.54%에 낙찰
오후들어 약세 폭이 커지면서 금리 상승폭 커져.

IRS, 금리 상승. 커브 스팅프닝.
3Y 호가 많았으며, 2*5Y,2*9Y,2*10Y,7*10Y 등의 스프레드 수요가 지속적으로 있었음.

CRS, 별다른 이슈 없이 3Y 이상 구간에서 금리 상승 마감.