IPS Daily Morning Brief

2018-02-14

종가 기준일 2018-02-13

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6850	-1.25	1.6880	1.6923	1.6845	1.7200	1.2925	2.6800	1.2875
9M	1.7525	-1.25	1.7540	1.7604	1.7509	1.8025	1.2750	2.7075	1.2500
1Y	1.8200	-1.25	1.8210	1.8339	1.8214	1.8850	1.2625	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9400	-2.25	1.9420	1.9529	1.9210	2.0050	1.2500	2.8100	1.1900
2Y	2.0325	-2.25	2.0320	2.0380	1.9916	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1475	-2.75	2.1475	2.1461	2.0787	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2275	-2.75	2.2230	2.2166	2.1351	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.2875	-2.50	2.2775	2.2636	2.1739	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3550	-2.50	2.3410	2.3174	2.2148	2.3925	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4450	-3.00	2.4280	2.3890	2.2749	2.4750	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.4825	-3.00	2.4655	2.4276	2.3133	2.5125	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.5000	-3.00	2.4830	2.4435	2.3261	2.5300	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5200	-2.75	2.5010	2.4609	2.3314	2.5475	1.2625	3.7325	1.2150
6*9M	6.75	0.00	6.60	6.81	6.64	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.75	0.00	6.70	7.35	7.05	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	21.25	-1.00	21.10	20.41	17.02	22.75	-3.75	22.75	-5.50
2*3Y	11.50	-0.50	11.55	10.81	8.71	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	19.50	-0.50	19.10	17.86	14.35	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	25.50	-0.25	24.55	22.56	18.23	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	8.00	0.00	7.55	7.05	5.65	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	14.00	0.25	13.00	11.75	9.53	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	6.00	0.25	5.45	4.70	3.88	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.75	0.00	6.35	5.38	4.09	10.50	0.75	15.25	0.25
5*10Y	15.75	-0.50	15.05	12.54	10.10	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	9.00	-0.50	8.70	7.16	6.01	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.86	3.84	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.50	5.45	5.12	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.50	0.25	7.30	7.19	5.65	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.865	-1.00	1.858	1.838	1.837	1.885	1.297	2.720	1.237
1.5Y	2.056	-2.30	2.059	2.026	2.001	2.079	1.302	2.820	1.232
2Y	2.172	-3.00	2.182	2.162	2.107	2.230	1.295	2.920	1.225
3Y	2.272	-3.30	2.277	2.244	2.163	2.306	1.250	3.050	1.200
4Y	2.425	-2.90	2.422	2.411	2.321	2.496	1.310	3.280	1.232
5Y	2.540	-2.90	2.530	2.511	2.391	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.684	-3.10	2.670	2.643	2.520	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.777	-3.50	2.763	2.720	2.579	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.734	-2.50	2.725	2.663	2.541	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	107.60	0.13	107.51	107.60	107.49
LKTB	119.15	0.35	118.95	119.21	118.84

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	-4.50	-0.25	-3.70	-0.42	-1.52	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-11.60	0.05	-11.74	-7.32	-8.00	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.95	0.75	-14.96	-12.44	-11.56	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.45	0.55	-12.91	-9.78	-8.42	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-19.75	0.15	-19.90	-19.44	-18.58	-7.75	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-25.25	0.40	-25.23	-24.73	-21.75	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.90	0.60	-32.86	-32.58	-30.50	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.20	0.50	-33.52	-33.13	-30.45	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-21.40	-0.25	-22.36	-20.21	-21.00	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-55.00	0.75
-60.50	1.75
-63.75	0.25
-65.25	1.25
-65.75	1.75
-66.25	2.00
-62.50	2.00
-56.50	2.50

CRS

USD/KRW 1084.50 (-0.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2700	-0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00
1.5Y	1.3350	-0.50	1.6600	0.9150	2*3Y	2.05	0.00
2Y	1.3950	-2.00	1.6950	0.8850	2*5Y	23.00	1.50
3Y	1.4950	-1.50	1.7550	0.8550	3*4Y	7.50	0.50
4Y	1.5700	-1.00	1.8000	0.8400	3*5Y	13.00	1.00
5Y	1.6250	-0.50	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	0.50
7Y	1.7300	-0.50	1.8950	0.8050	5*7Y	10.50	0.00
10Y	1.8800	-0.50	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	2.1143	0.0329	2.0814	2.0650	2.1054	2.1649	0.7300	2.1649	0.2800
10Y	2.8294	-0.0308	2.8602	2.8557	2.8284	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	-5.77	6.29	-12.06	-12.50	-8.16	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	5.24	0.42	4.82	8.87	8.04	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	41.25	-0.75	42.00	39.00	38.75	42.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	60.50	-0.50	61.00	57.70	56.10	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	71.51	-6.37	77.88	79.07	72.30	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	82.75		
1.5Y	94.5 / 95		
02Y		SPRD	10*20Y 7.5
03Y			11*20Y 5.75
04Y			
05Y	29.5 / 30. / 30.25 / 30.5		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	155 건	13	142	168	194	136	162	130
금 액	33,483 억원	-4,669	38,152	62,328	59,750	32,260	45,602	30,285

장중동향

국고채 금리, 미 국채금리 반등세가 주춤해진 가운데 저가매수세 유입되면서 금리 하락 마감.

IRS, 연휴앞두고 거래 활발한 가운데 전구간 금리 하락.
장 시작부터 2~3Y구간에서 역외 오퍼가 유입되면서 금리 하락.
5Y 구간은 증권사 본드 스왑으로 추정되는 비드 출현.

CRS 금리도 전구간 하락.