IPS Daily Morning Brief

2018-02-20

종가 기준일 2018-02-19

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7000	0.75	1.6925	1.6940	1.6904	1.7200	1.3025	2.6800	1.2875
9M	1.7750	1.75	1.7600	1.7618	1.7545	1.8025	1.2850	2.7075	1.2500
1Y	1.8425	1.75	1.8275	1.8330	1.8238	1.8850	1.2700	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9675	2.75	1.9455	1.9530	1.9253	2.0050	1.2550	2.8100	1.1900
2Y	2.0625	3.25	2.0370	2.0411	1.9973	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1825	3.75	2.1530	2.1540	2.0862	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2650	4.25	2.2320	2.2286	2.1441	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.3225	4.25	2.2900	2.2793	2.1843	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3850	4.50	2.3520	2.3378	2.2268	2.3925	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4750	4.50	2.4420	2.4153	2.2892	2.4750	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.5125	4.50	2.4795	2.4526	2.3275	2.5125	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.5300	4.50	2.4970	2.4690	2.3411	2.5300	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5500	4.50	2.5170	2.4871	2.3481	2.5500	1.2625	3.7325	1.2150
6*9M	7.50	1.00	6.75	6.78	6.42	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.75	0.00	6.75	7.13	6.93	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	22.00	1.50	20.95	20.81	17.35	22.75	-3.75	22.75	-5.50
2*3Y	12.00	0.50	11.60	11.29	8.90	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	20.25	1.00	19.50	18.75	14.69	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	26.00	1.00	25.30	23.81	18.71	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	8.25	0.50	7.90	7.46	5.79	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	14.00	0.50	13.70	12.53	9.81	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.75	0.00	5.80	5.06	4.02	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.25	0.25	6.20	5.85	4.25	10.50	1.00	15.25	0.25
5*10Y	15.25	0.25	15.20	13.60	10.49	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	9.00	0.00	9.00	7.75	6.24	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.74	3.83	4.50	0.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.50	5.37	5.19	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.50	0.00	7.50	7.19	5.89	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.878	1.10	1.869	1.847	1.839	1.885	1.335	2.720	1.237
1.5Y	2.072	1.80	2.058	2.037	2.004	2.079	1.319	2.820	1.232
2Y	2.205	3.70	2.176	2.174	2.112	2.230	1.297	2.920	1.225
3Y	2.302	4.00	2.272	2.260	2.171	2.306	1.250	3.050	1.200
4Y	2.450	4.20	2.420	2.423	2.328	2.496	1.312	3.280	1.232
5Y	2.567	5.10	2.531	2.527	2.403	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.708	4.70	2.675	2.662	2.532	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.795	4.30	2.766	2.745	2.594	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.758	3.80	2.730	2.692	2.554	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	107.54	-0.10	107.56	107.57	107.51
LKTB	119.03	-0.36	119.04	119.09	118.83

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	-3.55	0.65	-4.13	-1.42	-1.56	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-10.45	0.95	-11.25	-8.37	-7.89	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-14.25	-0.45	-13.92	-13.31	-11.44	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.95	-0.25	-11.90	-10.64	-8.45	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-18.50	0.05	-18.78	-19.40	-18.40	-7.95	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-24.45	-0.85	-24.10	-24.80	-21.89	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.30	-0.20	-32.30	-32.44	-30.55	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.00	0.20	-32.36	-33.02	-30.52	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-20.80	0.70	-21.34	-20.52	-20.56	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-51.25	3.25
-57.75	2.25
-61.25	1.75
-63.75	1.25
-65.00	0.75
-65.75	0.75
-61.50	0.50
-55.00	1.00

CRS

USD/KRW 1067.60 (-9.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3300	5.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00
1.5Y	1.3900	5.00	1.6600	0.9150	2*3Y	2.05	0.00
2Y	1.4500	5.00	1.6950	0.8850	2*5Y	21.50	0.00
3Y	1.5450	5.00	1.7550	0.8550	3*4Y	7.00	0.00
4Y	1.6150	5.00	1.8000	0.8400	3*5Y	12.00	0.00
5Y	1.6650	5.00	1.8500	0.8350	4*5Y	5.00	0.00
7Y	1.7700	5.00	1.8950	0.8050	5*7Y	10.50	0.00
10Y	1.9250	5.50	2.0150	0.7900	5*10Y	26.00	0.50

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	0.0000	2.1936	2.1885	2.1677	2.1936	0.7400	2.1936	0.2800
10Y	2.8786	0.0000	2.8786	2.9095	2.9058	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	-1.14	-3.7	2.56	2.05	-0.03	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	8.36	-4.30	12.66	15.75	15.38	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	1.25	40.00	40.00	40.00	42.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	59.00	0.60	58.40	58.40	58.40	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	68.50	0.00	68.50	72.10	73.81	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	77.25		
01Y	84		
1.5Y	96.5		
02Y	6	SPRD	
03Y			
04Y			
05Y	31.25 / 31.5		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	92 건	4	88	0	88	155	142	168
금 액	22,237 억원	-1,003	23,240	0,000	23,240	33,483	38,152	62,328

장중동향

연휴동안 글로벌 금리상승을 반영하며 약세 출발한 채권은 큰 변동성없이 약세. 10년물 입찰호조로 낙폭을 소폭 되돌림.

IRS는 채권금리 상승에 연동해 전체적으로 레벨상승. 커브는 스팁 마감. 오전에는 거래가 많지않고 레벨만 조정되다가 오후들어 거래가 활발.

CRS는 전테너 5bp정도 상승 마감.