

IPS Daily Morning Brief

2018-02-21

종가 기준일 2018-02-20

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7025	0.25	1.6960	1.6949	1.6918	1.7200	1.3025	2.6775	1.2875
9M	1.7775	0.25	1.7650	1.7631	1.7555	1.8025	1.2850	2.7075	1.2500
1Y	1.8425	0.00	1.8320	1.8336	1.8244	1.8850	1.2700	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9725	0.50	1.9520	1.9545	1.9265	2.0050	1.2550	2.8100	1.1900
2Y	2.0725	1.00	2.0450	2.0439	1.9991	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1950	1.25	2.1625	2.1580	2.0887	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2750	1.00	2.2415	2.2336	2.1470	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.3325	1.00	2.2990	2.2851	2.1876	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3950	1.00	2.3600	2.3445	2.2306	2.3950	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4850	1.00	2.4500	2.4234	2.2935	2.4850	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.5225	1.00	2.4875	2.4605	2.3318	2.5225	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.5400	1.00	2.5050	2.4770	2.3456	2.5400	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5600	1.00	2.5250	2.4953	2.3530	2.5600	1.2625	3.7325	1.2150

6*9M	7.50	0.00	6.90	6.83	6.38	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.50	-0.25	6.70	7.05	6.89	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	23.00	1.00	21.30	21.03	17.47	23.00	-3.75	23.00	-5.50
2*3Y	12.25	0.25	11.75	11.41	8.96	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	20.25	0.00	19.65	18.98	14.80	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	26.00	0.00	25.40	24.13	18.85	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	8.00	-0.25	7.90	7.56	5.83	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	13.75	-0.25	13.65	12.71	9.89	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.75	0.00	5.75	5.15	4.06	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.25	0.00	6.10	5.94	4.30	10.50	1.00	15.25	0.25
5*10Y	15.25	0.00	15.10	13.83	10.59	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	9.00	0.00	9.00	7.89	6.29	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.71	3.83	4.50	0.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.50	5.36	5.21	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.50	0.00	7.50	7.19	5.95	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.890	1.20	1.874	1.851	1.840	1.890	1.335	2.720	1.237
1.5Y	2.080	0.80	2.063	2.041	2.005	2.080	1.319	2.820	1.232
2Y	2.219	1.40	2.186	2.179	2.113	2.230	1.297	2.920	1.225
3Y	2.315	1.30	2.281	2.267	2.173	2.315	1.250	3.050	1.200
4Y	2.460	1.00	2.427	2.428	2.331	2.496	1.312	3.280	1.232
5Y	2.577	1.00	2.538	2.533	2.407	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.719	1.10	2.682	2.669	2.536	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.810	1.50	2.772	2.754	2.599	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.777	1.90	2.739	2.703	2.558	2.777	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	107.50	-0.04	107.55	107.57	107.46
LKTb	118.92	-0.11	119.04	119.14	118.74

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-4.75	-1.20	-4.18	-1.74	-1.56	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-10.75	-0.30	-11.08	-8.64	-7.84	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-14.65	-0.40	-14.06	-13.53	-11.44	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.00	-0.05	-11.81	-10.88	-8.45	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-18.50	0.00	-18.53	-19.43	-18.35	-7.95	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-24.45	0.00	-23.94	-24.83	-21.94	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.40	-0.10	-32.20	-32.45	-30.56	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.50	-0.50	-32.22	-33.03	-30.54	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-21.70	-0.90	-21.40	-20.73	-20.47	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1073.50 (+5.90)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-53.25	-2.00	1Y	1.3100	-2.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00
-59.75	-2.00	1.5Y	1.3750	-1.50	1.6600	0.9150	2*3Y	2.05	0.00
-63.25	-2.00	2Y	1.4400	-1.00	1.6950	0.8850	2*5Y	21.50	0.00
-66.00	-2.25	3Y	1.5350	-1.00	1.7550	0.8550	3*4Y	7.00	0.00
-67.00	-2.00	4Y	1.6050	-1.00	1.8000	0.8400	3*5Y	12.00	0.00
-67.75	-2.00	5Y	1.6550	-1.00	1.8500	0.8350	4*5Y	5.00	0.00
-63.50	-2.00	7Y	1.7600	-1.00	1.8950	0.8050	5*7Y	10.50	0.00
-57.00	-2.00	10Y	1.9150	-1.00	2.0150	0.7900	5*10Y	26.00	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	2.2229	0.0293	2.1936	2.1936	2.1885	2.2229	0.7400	2.2229	0.2800
10Y	2.8877	0.0091	2.8786	2.8786	2.9095	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	0.39	1.53	-1.14	2.56	2.05	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	7.77	-0.59	8.36	12.66	15.75	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	0.00	41.25	40.00	40.00	42.50	3.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	59.10	0.10	59.00	58.40	58.40	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	66.48	-2.02	68.50	68.50	72.10	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS				ODD Tenor					
06M									
09M									
01Y	84.5 / 84 / 84.25								
1.5Y	97.75								
02Y				SPRD	2*10Y	41.25 / 41.75			
03Y	19.25 / 19				9*10Y	2.5			
04Y	27.5 / 27				3*4Y	8.25			
05Y					1*2Y	23			
07Y					5*9Y	12.75			
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	113 건	21	92	88	0	88	155	142	
금 액	46,665 억원	24,428	22,237	23,240	0,000	23,240	33,483	38,152	

장중동향
국고채 금리 상승.
아소 다로 일본 부총리 겸 재무상이 물가 목표 달성을 위해 현행 금융정책을 지속할 필요가 있다고 발언, 호주중앙은행(RBA)도 물가가 여전히 낮은 상태라고 지적하면서 약세 분위기에 힘을 실음.

IRS, 1년을 제외한 전 구간에서 상승.
미국 장이 휴장했음에도 아시아장에서 미국 금리상승에 약세 분위기.

CRS, 단기쪽 예셋 거래 영향으로 전테너 하락 마감.