

IPS Daily Morning Brief

2018-02-22

종가 기준일 2018-02-21

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7025	0.00	1.6980	1.6956	1.6932	1.7200	1.3025	2.6775	1.2875
9M	1.7750	-0.25	1.7685	1.7641	1.7566	1.8025	1.2850	2.7075	1.2500
1Y	1.8400	-0.25	1.8350	1.8340	1.8251	1.8850	1.2700	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9700	-0.25	1.9580	1.9558	1.9279	2.0050	1.2550	2.8100	1.1900
2Y	2.0650	-0.75	2.0520	2.0461	2.0010	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1900	-0.50	2.1715	2.1616	2.0913	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2700	-0.50	2.2510	2.2383	2.1501	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.3275	-0.50	2.3085	2.2906	2.1910	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3900	-0.50	2.3700	2.3509	2.2344	2.3950	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4800	-0.50	2.4600	2.4313	2.2979	2.4850	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.5175	-0.50	2.4975	2.4681	2.3362	2.5225	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.5350	-0.50	2.5150	2.4848	2.3502	2.5400	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5550	-0.50	2.5350	2.5031	2.3580	2.5600	1.2625	3.7325	1.2150

6*9M	7.25	-0.25	7.05	6.85	6.34	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.50	0.00	6.65	6.99	6.85	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	22.50	-0.50	21.70	21.21	17.60	23.00	-3.75	23.00	-5.50
2*3Y	12.50	0.25	11.95	11.55	9.03	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	20.50	0.25	19.90	19.21	14.90	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	26.25	0.25	25.65	24.45	19.00	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	8.00	0.00	7.95	7.66	5.88	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	13.75	0.00	13.70	12.90	9.97	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.75	0.00	5.75	5.24	4.09	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.25	0.00	6.15	6.03	4.34	10.50	1.00	15.25	0.25
5*10Y	15.25	0.00	15.15	14.06	10.69	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	9.00	0.00	9.00	8.04	6.35	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.69	3.83	4.50	0.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.50	5.35	5.23	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.50	0.00	7.50	7.19	6.01	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.886	-0.40	1.878	1.855	1.840	1.890	1.335	2.720	1.237
1.5Y	2.075	-0.50	2.067	2.045	2.006	2.080	1.319	2.820	1.232
2Y	2.210	-0.90	2.194	2.183	2.115	2.230	1.297	2.920	1.225
3Y	2.310	-0.50	2.290	2.272	2.176	2.315	1.250	3.050	1.200
4Y	2.452	-0.80	2.436	2.432	2.333	2.496	1.312	3.280	1.232
5Y	2.565	-1.20	2.548	2.539	2.411	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.709	-1.00	2.692	2.675	2.540	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.802	-0.80	2.782	2.761	2.603	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.774	-0.30	2.750	2.713	2.562	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	107.55	0.05	107.54	107.61	107.52
LKTb	119.01	0.09	119.06	119.24	118.95

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	-4.60	0.15	-4.26	-2.07	-1.54	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-10.50	0.25	-10.90	-8.92	-7.78	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-14.50	0.15	-14.20	-13.73	-11.43	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.00	0.00	-11.87	-11.08	-8.46	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-18.20	0.30	-18.46	-19.40	-18.30	-7.95	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.75	0.70	-23.97	-24.80	-21.98	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.90	0.50	-32.16	-32.42	-30.57	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.20	0.30	-32.22	-33.02	-30.55	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-21.90	-0.20	-21.48	-21.03	-20.36	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1076.20 (+2.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-54.00	-0.75	1Y	1.3000	-1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00	
-60.50	-0.75	1.5Y	1.3650	-1.00	1.6600	0.9150	2*3Y	2.05	0.00	
-64.50	-1.25	2Y	1.4200	-2.00	1.6950	0.8850	2*5Y	21.00	-0.50	
-68.00	-2.00	3Y	1.5100	-2.50	1.7550	0.8550	3*4Y	7.00	0.00	
-69.00	-2.00	4Y	1.5800	-2.50	1.8000	0.8400	3*5Y	12.00	0.00	
-69.75	-2.00	5Y	1.6300	-2.50	1.8500	0.8350	4*5Y	5.00	0.00	
-65.50	-2.00	7Y	1.7350	-2.50	1.8950	0.8050	5*7Y	10.50	0.00	
-59.00	-2.00	10Y	1.8900	-2.50	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	2.2661	0.0432	2.2229	2.1936	2.1936	2.2661	0.7400	2.2661	0.2800
10Y	2.9500	0.0623	2.8877	2.8786	2.8786	2.9500	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	5.61	5.22	0.39	-1.14	2.56	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	14.80	7.03	7.77	8.36	12.66	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	41.50	0.25	41.25	41.25	40.00	42.50	3.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	59.20	0.10	59.10	59.00	58.40	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	68.39	1.91	66.48	68.50	68.50	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	70									
09M	77.5									
01Y	83.75 / 84									
1.5Y	96.5									
02Y	06 / 6.25 / 6.75				SPRD					
03Y	18.75									
04Y						1*3Y 35				
05Y	31.25 / 31.5 / 32.75									
07Y										
10Y	47.75									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			101 건	-12	113	92	88	0	88	155
금 액			32,607 억원	-14,058	46,665	22,237	23,240	0,000	23,240	33,483

장중동향
국고채 금리, 미 FOMC 회의록 공개를 앞두고 금리 소폭 하락.

IRS, 뚜렷한 방향성 없이 국채선물 움직임에 연동되며 금리 하락 마감.

CRS, 에셋스왑 수요가 늘면서 금리 하락.