IPS Daily Morning Brief

2018-02-23

종가 기준일 2018-02-22

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6975	-0.50	1.6990	1.6959	1.6946	1.7200	1.3025	2.6775	1.2875
9M	1.7725	-0.25	1.7715	1.7646	1.7578	1.8025	1.2850	2.7075	1.2500
1Y	1.8375	-0.25	1.8375	1.8339	1.8260	1.8850	1.2700	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9600	-1.00	1.9620	1.9560	1.9295	2.0050	1.2550	2.8100	1.1900
2Y	2.0575	-0.75	2.0575	2.0475	2.0033	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1825	-0.75	2.1790	2.1646	2.0943	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2625	-0.75	2.2590	2.2424	2.1535	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.3200	-0.75	2.3165	2.2956	2.1948	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3850	-0.50	2.3790	2.3566	2.2387	2.3950	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4775	-0.25	2.4695	2.4384	2.3027	2.4850	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.5150	-0.25	2.5070	2.4754	2.3410	2.5225	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.5325	-0.25	2.5245	2.4921	2.3553	2.5400	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5525	-0.25	2.5445	2.5106	2.3634	2.5600	1.2625	3.7325	1.2150

6*9M	7.50	0.25	7.25	6.88	6.32	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.50	0.00	6.60	6.93	6.83	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	22.00	-0.50	22.00	21.36	17.72	23.00	-3.75	23.00	-5.50
2*3Y	12.50	0.00	12.15	11.71	9.10	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	20.50	0.00	20.15	19.49	15.02	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	26.25	0.00	25.90	24.81	19.15	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	8.00	0.00	8.00	7.78	5.92	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	13.75	0.00	13.75	13.10	10.05	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.75	0.00	5.75	5.32	4.13	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.50	0.25	6.25	6.10	4.39	10.50	1.00	15.25	0.25
5*10Y	15.75	0.50	15.30	14.28	10.80	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	9.25	0.25	9.05	8.18	6.40	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.70	3.83	4.50	0.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.50	5.37	5.25	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.50	0.00	7.50	7.23	6.07	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.872	-1.40	1.879	1.858	1.841	1.890	1.335	2.720	1.237
1.5Y	2.060	-1.50	2.068	2.048	2.006	2.080	1.319	2.820	1.232
2Y	2.196	-1.40	2.200	2.186	2.117	2.230	1.297	2.920	1.225
3Y	2.295	-1.50	2.297	2.277	2.179	2.315	1.250	3.050	1.200
4Y	2.445	-0.70	2.443	2.435	2.336	2.496	1.312	3.280	1.232
5Y	2.555	-1.00	2.556	2.542	2.415	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.702	-0.70	2.700	2.680	2.544	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.800	-0.20	2.792	2.768	2.609	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.783	0.90	2.762	2.724	2.567	2.783	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	0.05	107.49	107.60	107.49
LKTB	119.03	0.02	118.79	119.03	118.70

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	-3.45	1.15	-4.11	-2.37	-1.47	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-10.00	0.50	-10.62	-9.22	-7.68	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.85	0.65	-14.21	-13.88	-11.41	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.25	0.75	-11.78	-11.19	-8.45	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-18.25	-0.05	-18.40	-19.29	-18.23	-7.95	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.50	0.25	-23.95	-24.66	-22.00	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.70	0.20	-32.08	-32.35	-30.58	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.25	-0.05	-32.23	-33.01	-30.59	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-23.05	-1.15	-21.79	-21.35	-20.38	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-53.75	0.25
-60.00	0.50
-64.25	0.25
-68.25	-0.25
-69.25	-0.25
-70.00	-0.25
-65.50	0.00
-59.25	-0.25

CRS

USD/KRW 1084.30 (+8.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3000	0.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00
1.5Y	1.3600	-0.50	1.6600	0.9150	2*3Y	2.05	0.00
2Y	1.4150	-0.50	1.6950	0.8850	2*5Y	20.50	-0.50
3Y	1.5000	-1.00	1.7550	0.8550	3*4Y	7.00	0.00
4Y	1.5700	-1.00	1.8000	0.8400	3*5Y	12.00	0.00
5Y	1.6200	-1.00	1.8500	0.8350	4*5Y	5.00	0.00
7Y	1.7300	-0.50	1.8950	0.8050	5*7Y	11.00	0.50
10Y	1.8850	-0.50	2.0150	0.7900	5*10Y	26.50	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	2.2541	-0.0120	2.2661	2.2229	2.1936	2.2661	0.7400	2.2661	0.2800
10Y	2.9207	-0.0293	2.9500	2.8877	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	5.81	0.2	5.61	0.39	-1.14	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	12.07	-2.73	14.80	7.77	8.36	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	0.50	41.50	41.25	41.25	42.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	60.40	1.20	59.20	59.10	59.00	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	66.66	-1.73	68.39	66.48	68.50	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	
06M	70 / 70.25		
09M	77 / 77.25 / 77.75		
01Y	83.75 / 84.5		
1.5Y			
02Y	5.75 / 6.5 / 07	SPRD	6*9m 7.25 / 7.5
03Y	18.25 / 19.25		2*5y 27.25
04Y	27.25		3*4y 08 / 8.5
05Y	32.5 / 34.25		
07Y			
10Y	50 / 50.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	126 건	25	101	113	92	88	0	88
금 액	61,225 억원	28,618	32,607	46,665	22,237	23,240	0,000	23,240

장중동향

전일 미국금리 상승으로 하락 출발한 국채선물은 외국인의 국고채 5년물 매수로 하락폭을 줄이고 강보합 마감. 채권금리는 단기물 하락 장기물 상승 마감.

IRS는 현물에 비해 비디시한 모습을 보이며 전테너 소폭 하락마감. 특히 1.5년이 -1bp하락하며 가장 많이 하락.

CRS도 소폭 하락 마감.