IPS Daily Morning Brief

2018-02-28

종가 기준일 2018-02-27

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7125	-0.25	1.7095	1.6965	1.6974	1.7200	1.3025	2.6775	1.2875
9M	1.7750	-0.25	1.7765	1.7634	1.7610	1.8025	1.2850	2.7075	1.2500
1Y	1.8350	-0.25	1.8385	1.8298	1.8292	1.8850	1.2700	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9350	-0.25	1.9515	1.9491	1.9338	2.0050	1.2550	2.8100	1.1900
2Y	2.0250	-0.25	2.0450	2.0406	2.0094	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1425	-0.50	2.1670	2.1599	2.1024	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2150	-0.75	2.2445	2.2386	2.1624	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.2700	-1.00	2.3020	2.2943	2.2048	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3300	-1.50	2.3660	2.3569	2.2500	2.3950	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4200	-1.75	2.4575	2.4425	2.3158	2.4850	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.4600	-1.75	2.4965	2.4803	2.3542	2.5225	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.4775	-1.75	2.5140	2.4978	2.3690	2.5400	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.4975	-1.75	2.5340	2.5166	2.3783	2.5600	1.2625	3.7325	1.2150
6*9M	6.25	0.00	6.70	6.69	6.36	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.00	0.00	6.20	6.64	6.82	10.50	-1.50	10.50	-4.25
1*2Y	19.00	0.00	20.65	21.09	18.02	23.00	-3.75	23.00	-5.50
2*3Y	11.75	-0.25	12.20	11.93	9.30	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	19.00	-0.50	19.95	19.80	15.30	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	24.50	-0.75	25.70	25.36	19.54	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	7.25	-0.25	7.75	7.88	6.00	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	12.75	-0.50	13.50	13.44	10.24	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.50	-0.25	5.75	5.56	4.24	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.00	-0.50	6.40	6.26	4.53	10.50	1.00	15.25	0.25
5*10Y	15.00	-0.75	15.55	14.83	11.10	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	9.00	-0.25	9.15	8.56	6.57	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	3.90	3.78	3.84	4.50	0.00	7.75	-0.25
10*15Y	5.75	0.00	5.65	5.52	5.33	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.75	0.00	7.65	7.41	6.25	7.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.857	0.10	1.867	1.861	1.842	1.890	1.338	2.720	1.237
1.5Y	2.035	-0.10	2.050	2.049	2.010	2.080	1.319	2.820	1.232
2Y	2.167	0.00	2.184	2.182	2.124	2.230	1.297	2.920	1.225
3Y	2.260	0.30	2.280	2.275	2.188	2.315	1.250	3.050	1.200
4Y	2.405	0.50	2.425	2.428	2.345	2.496	1.312	3.280	1.232
5Y	2.515	0.50	2.536	2.537	2.427	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.654	-0.30	2.683	2.678	2.557	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.732	-1.80	2.776	2.771	2.623	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.740	-1.00	2.768	2.738	2.584	2.792	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	107.75	0.00	107.75	107.81	107.68
LKTB	119.70	0.17	119.54	119.81	119.35

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	-2.20	-0.35	-2.85	-3.08	-1.28	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-10.00	-0.15	-9.89	-10.02	-7.57	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-14.20	-0.25	-13.88	-14.12	-11.48	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.75	-0.80	-11.34	-11.55	-8.54	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-19.00	-1.25	-18.09	-18.95	-18.21	-8.20	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-24.50	-1.50	-23.40	-24.24	-22.20	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.40	-1.20	-31.66	-32.15	-30.69	-11.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.20	0.05	-31.87	-32.82	-30.68	-12.95	-38.70	-8.20	-38.70
20Y	-24.25	-0.75	-23.38	-22.09	-20.55	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-53.50	0.25
-57.50	0.25
-62.00	-0.25
-64.75	-1.50
-65.50	-2.75
-65.00	-3.00
-60.00	-2.50
-53.50	-2.25

CRS

USD/KRW 1071.30 (-2.10)

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	0.00	1.6600	0.9150	2*3Y	2.05	0.00
2Y	1.4050	-0.50	1.6950	0.8850	2*5Y	21.50	-3.50
3Y	1.4950	-2.00	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	-1.50
4Y	1.5600	-3.50	1.8000	0.8400	3*5Y	12.50	-2.00
5Y	1.6200	-4.00	1.8500	0.8350	4*5Y	6.00	-0.50
7Y	1.7300	-4.00	1.8950	0.8050	5*7Y	11.00	0.00
10Y	1.8850	-4.00	2.0150	0.7900	5*10Y	26.50	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	2.2661	0.0401	2.2260	2.2540	2.2541	2.2661	0.7400	2.2661	0.2800
10Y	2.8971	0.0329	2.8642	2.8669	2.9207	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	9.91	4.01	5.90	7.50	5.81	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	16.51	5.09	11.42	6.99	12.07	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	39.50	-1.50	41.00	42.25	42.00	42.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	56.50	-1.80	58.30	61.80	60.40	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	63.10	-0.72	63.82	61.29	66.66	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	71.5	ODD Tenor	
09M			
01Y	83.75		
1.5Y	94		
02Y	02 / 2.75	SPRD	1*2Y 18.75
03Y	14.25 / 14.5		1.5*2Y 8.75
04Y			2*3Y 12
05Y	27 / 27.5		2*5Y 25
07Y			
10Y	42.5 / 43.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	82 건	30	52	104	126	101	113	92
금 액	26,660 억원	15,405	11,255	49,970	61,225	32,607	46,665	22,237

장중동향

국고채 금리, 단기보다 장기금리가 많이 내리면서 커브 플래트닝.
금통위가 끝나고 기자간담회 시작 후 국채선물이 낙폭을 키우기 시작. 이주열 한은총재가 크게 매파 발언을 내놓은것은 아니었지만, 원론적 답변에 밀리는 장세 연출.

IRS, 국채선물 가격에 연동되며 장중 들락하며 금리 하락 마감.
장기구간으로 오퍼가 강한 모습, 1Y 구간으로 비디쉬한 모습.

CRS, 전일 현대캐피탈 부채스왑 물량이 소진되자 오퍼가 다시 나와 금리 하락 마감.