IPS Daily Morning Brief

2018-02-01

종가 기준일 2018-01-31

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7025	-1.50	1.7060	1.7004	1.6692	1.7200	1.2925	2.6800	1.2875
9M	1.7725	-2.25	1.7790	1.7706	1.7424	1.8025	1.2750	2.7075	1.2500
1Y	1.8500	-2.25	1.8575	1.8456	1.8164	1.8850	1.2550	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9725	-2.75	1.9785	1.9559	1.9137	2.0050	1.2350	2.8100	1.1900
2Y	2.0650	-3.50	2.0670	2.0335	1.9835	2.1000	1.2175	2.8850	1.1675
3Y	2.1800	-3.75	2.1720	2.1271	2.0660	2.2175	1.2125	3.0275	1.1550
4Y	2.2625	-3.25	2.2415	2.1851	2.1189	2.2950	1.2125	3.1450	1.1575
5Y	2.3125	-2.75	2.2845	2.2249	2.1542	2.3400	1.2175	3.2400	1.1575
7Y	2.3650	-2.75	2.3370	2.2670	2.1911	2.3925	1.2300	3.3800	1.1675
10Y	2.4350	-2.50	2.4035	2.3276	2.2468	2.4600	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.4700	-2.50	2.4385	2.3683	2.2846	2.4950	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.4875	-2.00	2.4525	2.3825	2.2957	2.5075	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5050	-2.00	2.4700	2.3941	2.2983	2.5250	1.2625	3.7325	1.2150
6*9M	7.00	-0.75	7.30	7.03	7.32	12.50	-2.75	12.50	-6.00
9*12M	7.75	0.00	7.85	7.50	7.40	10.50	-2.00	10.50	-4.25
1*2Y	21.50	-1.25	20.95	18.79	16.71	22.75	-4.00	22.75	-5.50
2*3Y	11.50	-0.25	10.50	9.36	8.25	11.75	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	19.75	0.25	17.45	15.16	13.54	19.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	24.75	0.75	21.75	19.14	17.07	24.75	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	8.25	0.50	6.95	5.80	5.29	8.25	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	13.25	1.00	11.25	9.77	8.82	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.00	0.50	4.30	3.98	3.53	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	5.25	0.00	5.25	4.21	3.69	10.50	0.75	15.25	0.25
5*10Y	12.25	0.25	11.90	10.28	9.26	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	7.00	0.25	6.65	6.06	5.57	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.00	3.50	4.06	3.78	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.50	4.90	5.49	4.89	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.00	0.50	6.65	6.65	5.15	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.846	-0.80	1.835	1.826	1.831	1.885	1.282	2.720	1.237
1.5Y	2.036	-1.40	2.025	2.005	1.996	2.050	1.272	2.820	1.232
2Y	2.195	-3.50	2.187	2.131	2.100	2.230	1.255	2.920	1.225
3Y	2.270	-3.60	2.260	2.195	2.147	2.306	1.232	3.050	1.200
4Y	2.462	-3.40	2.444	2.370	2.306	2.496	1.260	3.280	1.232
5Y	2.566	-3.60	2.544	2.455	2.367	2.602	1.259	3.410	1.217
7Y	2.691	-3.70	2.666	2.580	2.495	2.728	1.325	3.563	1.270
10Y	2.770	-3.50	2.733	2.640	2.549	2.805	1.415	3.750	1.355
20Y	2.720	-3.70	2.661	2.584	2.513	2.757	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	107.42	0.08	107.39	107.46	107.33
LKTB	119.10	0.35	118.80	119.17	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	0.40	-1.45	2.21	2.00	-1.44	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-6.35	-1.35	-4.65	-4.91	-8.25	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.00	0.00	-12.04	-9.75	-11.61	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-9.00	-0.15	-8.84	-6.83	-8.12	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-19.95	0.15	-20.23	-18.45	-18.71	-4.75	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-25.35	0.85	-25.95	-23.00	-21.30	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.60	0.95	-32.90	-31.32	-30.43	-9.40	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.50	1.00	-32.95	-31.19	-30.23	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-21.50	1.70	-19.08	-18.96	-21.49	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-57.00	6.25
-62.75	6.75
-65.50	7.00
-66.50	5.25
-67.25	3.25
-66.75	2.75
-62.00	2.75
-55.00	2.50

CRS

USD/KRW 1067.90 (-5.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2800	4.00	1.6200	0.7650	1*2Y	13.00	-0.50
1.5Y	1.3450	4.00	1.6600	0.9150	2*3Y	10.50	-2.00
2Y	1.4100	3.50	1.6950	0.8850	2*5Y	23.50	-3.50
3Y	1.5150	1.50	1.7550	0.8550	3*4Y	7.50	-1.50
4Y	1.5900	0.00	1.8000	0.8400	3*5Y	13.00	-1.50
5Y	1.6450	0.00	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	0.00
7Y	1.7450	0.00	1.8950	0.8050	5*7Y	10.00	0.00
10Y	1.8850	0.00	2.0150	0.7900	5*10Y	24.00	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	2.1486	0.0243	2.1243	2.1242	2.1120	2.1486	0.7300	2.1486	0.2800
10Y	2.7054	-0.0158	2.7212	2.6949	2.6640	2.7212	1.5300	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	-4.64	5.93	-10.57	-9.58	-4.00	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-6.46	1.92	-8.38	-5.51	-1.60	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	37.00	1.00	36.00	33.25	31.50	41.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	57.50	0.00	57.50	53.00	52.80	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	55.68	-4.01	59.69	57.07	55.20	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	
06M	70.5		
09M	77.75		
01Y	84.25 / 84.5		
1.5Y			
02Y	6.25 / 6.5 / 7.5	SPRD	6*9M 7.25
03Y	18 / 18.25 / 19.25		3*5Y 12.5
04Y			12*20Y 3.5
05Y	31.5		
07Y			
10Y			
12Y	46		
15Y			
20Y	51		
CRS	1Y CCS 26		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	134 건	-49	183	84	94	97	94	81
금 액	35,432 억원	-18,383	53,815	32,420	20,523	21,569	29,070	29,390

장중동향

국고채 금리, 대부분 구간에서 하락. 금리가 많이 오른데 따른 되돌림.
BOJ 통화완화정책 유지가 되돌림 자극.
국고 30년물, 50년물은 전일 외인의 초장기물 매도 영향이 이어지며 금리 상승.

IRS, 전구간 금리 하락.
국채선물을 따라 움직이며 그간의 금리 상승을 되돌림.
단기물이 오퍼가 많이 나와 기븐되면서 거래. 2Y과 3Y을 중심으로 호가 대치.
CRS, 3Y이하 구간에서 금리 상승. 커브 플래트닝.