

IPS Daily Morning Brief

2018-02-03

종가 기준일 2018-02-02

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6900	-0.25	1.7045	1.6999	1.6736	1.7200	1.2925	2.6800	1.2875
9M	1.7525	-0.25	1.7745	1.7704	1.7451	1.8025	1.2750	2.7075	1.2500
1Y	1.8200	-0.75	1.8500	1.8459	1.8185	1.8850	1.2625	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9425	-1.00	1.9740	1.9594	1.9163	2.0050	1.2500	2.8100	1.1900
2Y	2.0275	-1.50	2.0670	2.0386	1.9862	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1500	-1.25	2.1835	2.1363	2.0697	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2325	-1.25	2.2620	2.1978	2.1235	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.2875	-1.00	2.3105	2.2391	2.1595	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3475	-0.75	2.3655	2.2834	2.1972	2.3925	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4200	-0.50	2.4345	2.3455	2.2537	2.4600	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.4575	-0.50	2.4705	2.3861	2.2918	2.4950	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.4750	-0.50	2.4860	2.4009	2.3033	2.5075	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.4925	-0.50	2.5035	2.4141	2.3063	2.5250	1.2625	3.7325	1.2150

6*9M	6.25	0.00	7.00	7.05	7.15	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.75	-0.50	7.55	7.55	7.34	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	20.75	-0.75	21.70	19.28	16.77	22.75	-3.75	22.75	-5.50
2*3Y	12.25	0.25	11.65	9.76	8.35	12.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	20.50	0.25	19.50	15.91	13.73	20.50	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	26.00	0.50	24.35	20.05	17.33	26.00	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	8.25	0.00	7.85	6.15	5.38	8.25	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	13.75	0.25	12.70	10.29	8.98	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.50	0.25	4.85	4.14	3.60	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.00	0.25	5.50	4.43	3.77	10.50	0.75	15.25	0.25
5*10Y	13.25	0.50	12.40	10.64	9.42	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	7.25	0.25	6.90	6.21	5.65	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.60	4.06	3.81	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.15	5.54	4.96	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.25	0.00	6.90	6.86	5.25	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.834	-0.90	1.845	1.829	1.832	1.885	1.297	2.720	1.237
1.5Y	2.009	-1.30	2.032	2.009	1.997	2.050	1.300	2.820	1.232
2Y	2.162	-1.30	2.196	2.141	2.102	2.230	1.287	2.920	1.225
3Y	2.245	-1.00	2.274	2.209	2.151	2.306	1.250	3.050	1.200
4Y	2.418	-2.40	2.459	2.384	2.310	2.496	1.306	3.280	1.232
5Y	2.522	-2.30	2.562	2.473	2.373	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.660	-1.40	2.689	2.600	2.501	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.752	-0.50	2.767	2.663	2.556	2.805	1.424	3.750	1.355
20Y	2.702	0.70	2.706	2.603	2.520	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	107.57	0.05	107.39	107.57	107.36
LKTb	119.28	0.03	118.65	119.28	118.55

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-1.40	0.15	0.48	1.69	-1.35	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-6.65	0.30	-5.82	-4.95	-8.06	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.45	-0.20	-12.94	-10.21	-11.60	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-9.50	-0.25	-9.01	-7.26	-8.13	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-18.55	1.15	-19.70	-18.60	-18.65	-5.60	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-23.45	1.30	-25.15	-23.42	-21.37	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.25	0.65	-32.33	-31.67	-30.42	-9.40	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.20	0.00	-33.23	-31.73	-30.28	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-20.95	-1.20	-20.27	-18.85	-21.34	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS		USD/KRW				1079.70 (+7.80)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-53.00	2.25	1Y	1.2900	1.50	1.6200	0.7650	1*2Y	12.00	-0.50
-59.25	2.50	1.5Y	1.3500	1.50	1.6600	0.9150	2*3Y	9.50	-0.50
-61.75	2.50	2Y	1.4100	1.00	1.6950	0.8850	2*5Y	22.50	-0.50
-64.50	1.75	3Y	1.5050	0.50	1.7550	0.8550	3*4Y	7.50	0.00
-65.25	1.75	4Y	1.5800	0.50	1.8000	0.8400	3*5Y	13.00	0.00
-65.25	1.50	5Y	1.6350	0.50	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	0.00
-61.25	1.25	7Y	1.7350	0.50	1.8950	0.8050	5*7Y	10.00	0.00
-54.50	1.00	10Y	1.8750	0.50	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	2.1453	-0.0196	2.1649	2.1486	2.1243	2.1649	0.7300	2.1649	0.2800
10Y	2.8415	0.0496	2.7919	2.7054	2.7212	2.8415	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	-1.67	-0.66	-1.01	-4.64	-10.57	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	8.95	5.46	3.49	-6.46	-8.38	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	39.25	1.00	38.25	37.00	36.00	41.50	3.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	59.00	0.80	58.20	57.50	57.50	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	69.62	6.92	62.70	55.68	59.69	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
	06M									
	09M	74.75								
	01Y									
	1.5Y 94.75									
	02Y 3.75 / 7.75				SPRD	2*5y	27.25			
	03Y 18.25 / 18.75 / 19 / 19.25					5*10y	14			
	04Y									
	05Y 31 / 31.5 / 34.75									
	07Y									
10Y 48.5										
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	1y 28.5									
	2y 41									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			133 건	-42	175	134	183	84	94	97
금 액			31,390 억원	-35,439	66,829	35,432	53,815	32,420	20,523	21,569

장중동향

국채선물은 미국 금리상승으로 하락출발. 약세를 유지하던 채권은 일본은행의 완화정책 유지 시그널과 코스피하락으로 강세전 환해 강보합 마감.

IRS는 5bp정도 큰폭으로 레벨이 올랐다가 하락 마감. 2년부터 5년까지 오퍼리시했고 5년쪽으로 역외 오퍼물량.

CRS는 전체적으로 레벨 상승 마감.