

IPS Daily Morning Brief

2018-02-06

종가 기준일 2018-02-05

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6950	0.50	1.6995	1.6995	1.6758	1.7200	1.2925	2.6800	1.2875
9M	1.7600	0.75	1.7670	1.7700	1.7465	1.8025	1.2750	2.7075	1.2500
1Y	1.8275	0.75	1.8395	1.8456	1.8195	1.8850	1.2625	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9550	1.25	1.9645	1.9606	1.9176	2.0050	1.2500	2.8100	1.1900
2Y	2.0475	2.00	2.0565	2.0411	1.9876	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1800	3.00	2.1780	2.1414	2.0718	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2650	3.25	2.2600	2.2046	2.1261	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.3200	3.25	2.3115	2.2469	2.1626	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3925	4.50	2.3705	2.2928	2.2008	2.3925	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4725	5.25	2.4425	2.3561	2.2579	2.4725	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.5100	5.25	2.4790	2.3966	2.2961	2.5100	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.5275	5.25	2.4955	2.4116	2.3078	2.5275	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5450	5.25	2.5130	2.4256	2.3110	2.5450	1.2625	3.7325	1.2150

6*9M	6.50	0.25	6.75	7.05	7.08	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.75	0.00	7.25	7.56	7.30	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	22.00	1.25	21.70	19.55	16.81	22.75	-3.75	22.75	-5.50
2*3Y	13.25	1.00	12.15	10.03	8.42	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	21.75	1.25	20.35	16.35	13.85	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	27.25	1.25	25.50	20.58	17.50	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	8.50	0.25	8.20	6.32	5.43	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	14.00	0.25	13.35	10.55	9.08	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.50	0.00	5.15	4.23	3.65	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	7.25	1.25	5.90	4.59	3.83	10.50	0.75	15.25	0.25
5*10Y	15.25	2.00	13.10	10.93	9.53	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	8.00	0.75	7.20	6.34	5.71	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.65	4.05	3.82	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.30	5.55	4.99	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.25	0.00	7.05	6.95	5.30	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.849	1.50	1.845	1.831	1.833	1.885	1.297	2.720	1.237
1.5Y	2.030	2.10	2.029	2.012	1.997	2.050	1.302	2.820	1.232
2Y	2.187	2.50	2.190	2.146	2.104	2.230	1.295	2.920	1.225
3Y	2.290	4.50	2.273	2.217	2.153	2.306	1.250	3.050	1.200
4Y	2.456	3.80	2.455	2.392	2.312	2.496	1.310	3.280	1.232
5Y	2.562	4.00	2.559	2.484	2.377	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.709	4.90	2.692	2.612	2.505	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.812	6.00	2.779	2.677	2.561	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.757	5.50	2.726	2.614	2.524	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	107.47	-0.10	107.49	107.54	107.45
LKTb	118.73	-0.55	118.79	119.07	118.69

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	-2.15	-0.75	-0.57	1.48	-1.32	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-7.50	-0.85	-6.49	-5.09	-7.97	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.95	-0.50	-13.33	-10.52	-11.59	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-11.00	-1.50	-9.52	-7.55	-8.16	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-19.10	-0.55	-19.48	-18.74	-18.62	-5.95	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-24.20	-0.75	-24.79	-23.68	-21.42	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.65	-0.40	-32.19	-31.89	-30.43	-9.90	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-33.95	-0.75	-33.67	-32.04	-30.31	-12.95	-38.70	-6.50	-38.70
20Y	-21.20	-0.25	-21.32	-18.81	-21.30	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1088.50 (+8.80)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-49.75	3.25	1Y	1.3300	4.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	-9.95	
-56.50	2.75	1.5Y	1.3900	4.00	1.6600	0.9150	2*3Y	2.05	-7.46	
-59.75	2.00	2Y	1.4500	4.00	1.6950	0.8850	2*5Y	23.50	1.00	
-62.50	2.00	3Y	1.5550	5.00	1.7550	0.8550	3*4Y	7.50	0.00	
-63.50	1.75	4Y	1.6300	5.00	1.8000	0.8400	3*5Y	13.00	0.00	
-63.50	1.75	5Y	1.6850	5.00	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	0.00	
-60.75	0.50	7Y	1.7850	5.00	1.8950	0.8050	5*7Y	10.00	0.00	
-54.75	-0.25	10Y	1.9250	5.00	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	2.0322	-0.1131	2.1453	2.1649	2.1486	2.1649	0.7300	2.1649	0.2800
10Y	2.7069	-0.1346	2.8415	2.7919	2.7054	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	-15.48	-13.81	-1.67	-1.01	-4.64	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-10.51	-19.46	8.95	3.49	-6.46	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	42.50	3.25	39.25	38.25	37.00	42.50	3.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	62.50	3.50	59.00	58.20	57.50	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	67.47	-2.15	69.62	62.70	55.68	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	83								
1.5Y	95 / 96								
02Y	3.75 / 4.5	SPRD	2*5Y		27.25				
03Y	16.5 / 18		3*10Y		28.75				
04Y			4*10Y		20.25 / 20.5				
05Y	31 / 31.75		5*10Y		14.5				
07Y	38								
10Y	45.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	130 건	-3	133	175	134	183	84	94	
금 액	30,285 억원	-1,105	31,390	66,829	35,432	53,815	32,420	20,523	

장중동향
국고채 금리, 전구간 상승. 미 국채금리 상승과 국고 30년물 입찰을 앞둔 부담 영향.

IRS, 미 국채 영향을 받으며 금리 상승. 커브 스티프닝.
5Y 이하 오퍼러시, 6Y 이후부터 비디쉬했던 장.

CRS도 별다른 이슈 없이 금리 상승 마감.