

IPS Daily Morning Brief

2018-02-07

종가 기준일 2018-02-06

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6825	-1.25	1.6925	1.6983	1.6777	1.7200	1.2925	2.6800	1.2875
9M	1.7500	-1.00	1.7580	1.7688	1.7477	1.8025	1.2750	2.7075	1.2500
1Y	1.8125	-1.50	1.8275	1.8443	1.8203	1.8850	1.2625	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9325	-2.25	1.9510	1.9603	1.9185	2.0050	1.2500	2.8100	1.1900
2Y	2.0200	-2.75	2.0405	2.0415	1.9885	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1400	-4.00	2.1625	2.1436	2.0732	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2225	-4.25	2.2455	2.2085	2.1279	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.2750	-4.50	2.2985	2.2514	2.1647	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3425	-5.00	2.3605	2.2986	2.2034	2.3925	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4200	-5.25	2.4345	2.3630	2.2608	2.4725	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.4575	-5.25	2.4715	2.4034	2.2991	2.5100	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.4750	-5.25	2.4890	2.4186	2.3109	2.5275	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.4925	-5.25	2.5065	2.4334	2.3144	2.5450	1.2625	3.7325	1.2150

6*9M	6.75	0.25	6.55	7.05	7.00	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.25	-0.50	6.95	7.55	7.26	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	20.75	-1.25	21.30	19.73	16.82	22.75	-3.75	22.75	-5.50
2*3Y	12.00	-1.25	12.20	10.21	8.47	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	20.25	-1.50	20.50	16.70	13.94	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	25.50	-1.75	25.80	20.99	17.62	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	8.25	-0.25	8.30	6.49	5.47	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	13.50	-0.50	13.60	10.78	9.15	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.25	-0.25	5.30	4.29	3.68	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.75	-0.50	6.20	4.73	3.87	10.50	0.75	15.25	0.25
5*10Y	14.50	-0.75	13.60	11.16	9.61	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	7.75	-0.25	7.40	6.44	5.74	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.70	4.04	3.83	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.45	5.56	5.01	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.25	0.00	7.20	7.04	5.36	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.845	-0.40	1.843	1.833	1.833	1.885	1.297	2.720	1.237
1.5Y	2.026	-0.40	2.025	2.014	1.998	2.050	1.302	2.820	1.232
2Y	2.162	-2.50	2.176	2.150	2.104	2.230	1.295	2.920	1.225
3Y	2.260	-3.00	2.264	2.222	2.155	2.306	1.250	3.050	1.200
4Y	2.413	-4.30	2.438	2.397	2.314	2.496	1.310	3.280	1.232
5Y	2.517	-4.50	2.542	2.490	2.380	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.662	-4.70	2.679	2.619	2.508	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.764	-4.80	2.771	2.686	2.564	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.719	-3.80	2.719	2.623	2.528	2.757	1.457	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.46	-4.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.58	0.11	107.62	107.70	107.58
LKTB	119.20	0.47	119.43	119.68	119.12

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	-3.25	-1.10	-1.59	1.17	-1.30	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-9.35	-1.85	-7.36	-5.36	-7.91	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-14.20	-0.25	-13.57	-10.84	-11.57	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.00	-1.00	-10.15	-7.86	-8.19	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-19.05	0.05	-19.27	-18.83	-18.61	-6.25	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-24.20	0.00	-24.39	-23.88	-21.48	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.95	-0.30	-31.87	-32.06	-30.44	-10.10	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-34.40	-0.45	-33.65	-32.32	-30.34	-12.95	-38.70	-6.50	-38.70
20Y	-22.65	-1.45	-21.21	-18.95	-21.31	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1091.50 (+3.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-53.25	-3.50	1Y	1.2800	-5.00	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00	
-58.25	-1.75	1.5Y	1.3500	-4.00	1.6600	0.9150	2*3Y	2.05	0.00	
-60.00	-0.25	2Y	1.4200	-3.00	1.6950	0.8850	2*5Y	23.50	0.00	
-61.50	1.00	3Y	1.5250	-3.00	1.7550	0.8550	3*4Y	7.50	0.00	
-62.25	1.25	4Y	1.6000	-3.00	1.8000	0.8400	3*5Y	13.00	0.00	
-62.00	1.50	5Y	1.6550	-3.00	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	0.00	
-58.75	2.00	7Y	1.7550	-3.00	1.8950	0.8050	5*7Y	10.00	0.00	
-52.50	2.25	10Y	1.8950	-3.00	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	2.1133	0.0811	2.0322	2.1453	2.1649	2.1649	0.7300	2.1649	0.2800
10Y	2.8029	0.0960	2.7069	2.8415	2.7919	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	-4.87	10.61	-15.48	-1.67	-1.01	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	3.89	14.40	-10.51	8.95	3.49	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	40.00	-2.50	42.50	39.25	38.25	42.50	3.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	60.20	-2.30	62.50	59.00	58.20	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	68.96	1.49	67.47	69.62	62.70	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	73.75 / 74 / 74.25								
01Y	80.5 / 81.25								
1.5Y	91 / 91.5 / 92.5								
02Y	99.75 / 1.5 / 1.75	SPRD							
03Y	11.25 / 13.5 / 14.75								
04Y									
05Y	24.5 / 25.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	162 건	32	130	133	175	134	183	84	
금 액	45,602 억원	15,317	30,285	31,390	66,829	35,432	53,815	32,420	

장중동향

국고채 금리, 전 구간 하락 마감.

미국 국채금리가 추가 하락에 따른 위험자산 선호로 급락한 영향을 받았음.

IRS, 전구간 하락 마감. 커브 플래트닝.

미국 증시 급락에 따른 안전자산 선호 분위기가 IRS 시장에도 그대로 이어졌음.

CRS, 금리 하락 마감.