

IPS Daily Morning Brief

2018-02-09

종가 기준일 2018-02-08

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6900	1.50	1.6865	1.6961	1.6805	1.7200	1.2925	2.6800	1.2875
9M	1.7575	2.00	1.7515	1.7661	1.7490	1.8025	1.2750	2.7075	1.2500
1Y	1.8250	2.25	1.8175	1.8410	1.8208	1.8850	1.2625	2.7450	1.2200
1.5Y	1.9450	3.00	1.9380	1.9581	1.9191	2.0050	1.2500	2.8100	1.1900
2Y	2.0350	3.50	2.0260	2.0409	1.9891	2.1000	1.2325	2.8850	1.1675
3Y	2.1500	3.75	2.1465	2.1451	2.0746	2.2175	1.2250	3.0275	1.1550
4Y	2.2225	3.75	2.2255	2.2118	2.1299	2.2950	1.2250	3.1450	1.1575
5Y	2.2750	4.25	2.2780	2.2556	2.1673	2.3400	1.2250	3.2400	1.1575
7Y	2.3375	4.75	2.3420	2.3046	2.2066	2.3925	1.2350	3.3800	1.1675
10Y	2.4225	5.25	2.4210	2.3713	2.2650	2.4725	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.4600	5.25	2.4585	2.4110	2.3033	2.5100	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.4775	5.25	2.4760	2.4265	2.3155	2.5275	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.4950	5.25	2.4935	2.4426	2.3196	2.5450	1.2625	3.7325	1.2150

6*9M	6.75	0.50	6.50	7.00	6.85	12.50	-2.50	12.50	-6.00
9*12M	6.75	0.25	6.60	7.49	7.17	10.50	-1.75	10.50	-4.25
1*2Y	21.00	1.25	20.85	19.99	16.84	22.75	-3.75	22.75	-5.50
2*3Y	11.50	0.25	12.05	10.43	8.55	13.25	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	18.75	0.25	19.95	17.09	14.08	21.75	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	24.00	0.75	25.20	21.48	17.81	27.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	7.25	0.00	7.90	6.66	5.53	8.50	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	12.50	0.50	13.15	11.05	9.27	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	5.25	0.50	5.25	4.39	3.74	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	6.25	0.50	6.40	4.90	3.94	10.50	0.75	15.25	0.25
5*10Y	14.75	1.00	14.30	11.56	9.77	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	8.50	0.50	7.90	6.66	5.83	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.98	3.83	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.50	5.53	5.05	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.25	0.00	7.25	7.14	5.47	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.852	1.50	1.843	1.835	1.834	1.885	1.297	2.720	1.237
1.5Y	2.059	2.40	2.032	2.019	1.999	2.059	1.302	2.820	1.232
2Y	2.187	3.00	2.171	2.156	2.105	2.230	1.295	2.920	1.225
3Y	2.277	3.50	2.263	2.232	2.157	2.306	1.250	3.050	1.200
4Y	2.421	4.00	2.418	2.403	2.316	2.496	1.310	3.280	1.232
5Y	2.525	4.50	2.521	2.498	2.383	2.602	1.270	3.410	1.217
7Y	2.657	4.00	2.661	2.628	2.511	2.728	1.357	3.563	1.270
10Y	2.748	3.60	2.758	2.698	2.569	2.812	1.424	3.750	1.355
20Y	2.710	2.00	2.716	2.637	2.533	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	107.58	-0.11	107.66	107.68	107.58
LKTb	119.40	-0.33	119.60	119.67	119.28

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	-2.70	0.75	-2.59	0.65	-1.36	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-11.40	0.60	-9.38	-6.13	-7.94	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-15.20	0.50	-14.50	-11.55	-11.56	-1.35	-25.15	5.50	-25.15
3Y	-12.70	0.25	-11.63	-8.67	-8.28	4.75	-19.50	8.75	-19.50
4Y	-19.85	-0.25	-19.23	-19.12	-18.60	-6.25	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-25.00	-0.25	-24.32	-24.19	-21.58	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.95	0.75	-31.90	-32.29	-30.44	-10.75	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.55	1.65	-33.66	-32.70	-30.37	-12.95	-38.70	-6.50	-38.70
20Y	-21.50	3.25	-22.21	-19.40	-21.29	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1087.90 (+1.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-49.50	0.25	1Y	1.3300	2.50	1.6200	0.7650	1*2Y	2.05	0.00	
-56.50	-2.00	1.5Y	1.3800	1.00	1.6600	0.9150	2*3Y	2.05	0.00	
-58.50	-2.50	2Y	1.4500	1.00	1.6950	0.8850	2*5Y	20.00	-0.50	
-61.50	-3.25	3Y	1.5350	0.50	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	0.00	
-62.25	-3.25	4Y	1.6000	0.50	1.8000	0.8400	3*5Y	11.50	0.00	
-62.50	-3.75	5Y	1.6500	0.50	1.8500	0.8350	4*5Y	5.00	0.00	
-58.25	-3.25	7Y	1.7550	1.50	1.8950	0.8050	5*7Y	10.50	1.00	
-52.75	-3.75	10Y	1.8950	1.50	2.0150	0.7900	5*10Y	24.50	1.00	

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	2.1054	-0.0202	2.1256	2.1133	2.0322	2.1649	0.7300	2.1649	0.2800
10Y	2.8284	-0.0088	2.8372	2.8029	2.7069	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	-8.16	-5.02	-3.14	-4.87	-15.48	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	8.04	-4.48	12.52	3.89	-10.51	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	38.75	1.75	37.00	40.00	42.50	42.50	3.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	56.10	0.60	55.50	60.20	62.50	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	72.30	1.14	71.16	68.96	67.47	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M	68.75								
09M									
01Y	81.75 / 82 / 82.5								
1.5Y	92.5 / 94.25								
02Y	01 / 1.25 / 1.5 / 2.5	SPRD	6*12m		13				
03Y			1*3y	31.25					
04Y	20 / 21.5 / 22.5		2*3y	11.25					
05Y	24.5 / 27.5		4*5y	05					
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	194 건	58	136	162	130	133	175	134	
금 액	59,750 억원	27,490	32,260	45,602	30,285	31,390	66,829	35,432	

장중동향

미국금리 영향으로 하락출발한 국채선물은 오후에 발표한 통화정책신행보고서의 영향과 증시상승으로 하락폭을 키워 금리 상승.

IRS도 이러한 영향으로 비드가 물리면서 레벨 상승. 커브는 스티프닝.

CRS도 비디시해 레벨 상승 마감.