IPS Daily Morning Brief

2018-01-17

종가 기준일 2018-01-16

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7175	-0.25	1.7120	1.7020	1.6420	1.7200	1.2925	2.6875	1.2875
9M	1.8000	-0.25	1.7875	1.7643	1.7217	1.8025	1.2650	2.7225	1.2500
1Y	1.8825	-0.25	1.8625	1.8341	1.7987	1.8850	1.2450	2.7675	1.2200
1.5Y	1.9950	-1.00	1.9715	1.9314	1.8955	2.0050	1.2275	2.8425	1.1900
2Y	2.0725	-1.00	2.0460	2.0010	1.9646	2.0825	1.2025	2.9200	1.1675
3Y	2.1600	-1.75	2.1375	2.0768	2.0463	2.1775	1.1975	3.0575	1.1550
4Y	2.2050	-2.50	2.1905	2.1225	2.0988	2.2300	1.2050	3.1725	1.1575
5Y	2.2425	-2.25	2.2285	2.1569	2.1331	2.2650	1.2075	3.2750	1.1575
7Y	2.2750	-2.00	2.2660	2.1909	2.1695	2.2950	1.2150	3.4350	1.1675
10Y	2.3300	-2.00	2.3240	2.2431	2.2227	2.3500	1.2525	3.5975	1.2125
12Y	2.3750	-2.00	2.3685	2.2819	2.2581	2.3950	1.2550	3.6300	1.2150
15Y	2.3900	-2.00	2.3835	2.2964	2.2680	2.4100	1.2575	3.6375	1.2150
20Y	2.4025	-1.75	2.3910	2.2980	2.2693	2.4200	1.2575	3.7850	1.2150

6*9M	8.25	0.00	7.55	6.23	7.97	12.50	-3.00	12.50	-6.00
9*12M	8.25	0.00	7.50	6.99	7.70	10.50	-2.00	10.50	-4.25
1*2Y	19.00	-0.75	18.35	16.69	16.60	20.75	-4.50	20.75	-5.50
2*3Y	8.75	-0.75	9.15	7.58	8.16	11.00	-1.00	14.25	-1.75
2*4Y	13.25	-1.50	14.45	12.15	13.42	18.00	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	17.00	-1.25	18.25	15.59	16.85	21.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	4.50	-0.75	5.30	4.58	5.26	7.75	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	8.25	-0.50	9.10	8.01	8.69	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	3.75	0.25	3.80	3.44	3.43	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	3.25	0.25	3.75	3.40	3.64	10.50	0.75	16.00	0.25
5*10Y	8.75	0.25	9.55	8.63	8.95	22.25	4.00	32.25	3.75
7*10Y	5.50	0.00	5.80	5.23	5.32	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.45	3.88	3.55	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	6.00	0.00	5.95	5.33	4.53	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.25	0.25	6.70	5.49	4.66	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	-0.10	1.836	1.838	1.831	1.885	1.252	2.720	1.237
1.5Y	2.038	-0.20	2.010	1.997	1.991	2.040	1.240	2.820	1.232
2Y	2.167	-0.30	2.132	2.094	2.086	2.170	1.225	2.920	1.225
3Y	2.225	-0.50	2.190	2.136	2.130	2.230	1.212	3.050	1.200
4Y	2.394	-1.20	2.365	2.296	2.290	2.406	1.242	3.280	1.232
5Y	2.464	-2.10	2.447	2.361	2.344	2.485	1.240	3.410	1.217
7Y	2.590	-2.20	2.574	2.480	2.470	2.612	1.300	3.563	1.270
10Y	2.637	-2.40	2.627	2.525	2.520	2.661	1.392	3.750	1.355
20Y	2.569	-0.50	2.564	2.491	2.487	2.580	1.451	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.66	0.00
CALL	1.51	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.60	0.06	107.56	107.61	107.50
LKTB	120.18	0.32	119.97	120.18	119.80

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	3.05	-0.15	2.67	-0.37	-3.23	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-4.30	-0.80	-3.89	-6.54	-9.51	2.40	-19.10	7.25	-19.10
2Y	-9.45	-0.70	-8.58	-9.33	-12.13	-1.35	-25.15	6.50	-25.15
3Y	-6.50	-1.25	-5.23	-5.91	-8.38	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-18.90	-1.30	-17.45	-17.37	-19.10	-3.20	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-22.15	-0.15	-21.85	-20.45	-21.06	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.50	0.20	-30.76	-28.94	-30.04	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-30.70	0.40	-30.30	-28.23	-29.71	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-16.65	-1.25	-17.32	-19.35	-21.75	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-45.25	0.00
-50.50	0.00
-52.50	0.00
-49.75	0.00
-47.75	0.00
-47.25	0.00
-44.50	0.00
-36.00	0.00

CRS

USD/KRW 1062.70 (0.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2650	-1.50	1.6200	0.7650	1*2Y	17.00	-0.50
1.5Y	1.3600	-1.50	1.6600	0.9800	2*3Y	15.00	-0.50
2Y	1.4350	-2.00	1.6950	0.9350	2*5Y	31.00	-0.50
3Y	1.5850	-2.50	1.7550	0.8550	3*4Y	8.50	0.00
4Y	1.6700	-2.50	1.8000	0.8400	3*5Y	16.00	0.00
5Y	1.7450	-2.50	1.8500	0.8350	4*5Y	7.50	0.00
7Y	1.7950	-2.50	1.8950	0.8050	5*7Y	5.00	0.00
10Y	1.9250	-2.50	2.0150	0.7900	5*10Y	18.00	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	2.0187	0.0125	2.0062	2.0062	1.9687	2.0187	0.6860	2.0187	0.2800
10Y	2.5384	-0.0100	2.5484	2.5484	2.5380	2.6060	1.5050	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	-14.83	1.55	-16.38	-10.08	-13.13	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-9.86	1.40	-11.26	-6.86	-5.20	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	25.75	-1.00	26.75	28.50	28.25	41.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	47.00	-2.10	49.10	51.00	49.00	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	51.97	-2.25	54.22	54.22	56.93	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	99.5 / 99.75		
02Y	7.25 / 7.0	SPRD	5*6Y 1.5
03Y	17 / 16.75 / 16.5 / 16		
04Y			
05Y	26 / 25.25 / 25		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y	40.5 / 40.75		
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	153 건	65	88	108	117	211	101	91
금 액	38,386 억원	7,101	31,285	48,373	40,448	71,572	32,135	36,910

장중동향

국고채 전일 상승폭을 일부 되돌리며 대체로 하락 마감.

IRS, 전 구간 하락 마감. 커브 플래트닝.
오전부터 초장기 테너 특히 20Y이 기븐되는 모습. (포린 오퍼 / 증권 비드)

CRS, 전 구간 하락 마감.