IPS Daily Morning Brief

2018-01-31

종가 기준일 2018-01-30

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7175	-0.25	1.7030	1.7001	1.6667	1.7200	1.2925	2.6800	1.2875
9M	1.7950	-0.25	1.7755	1.7694	1.7406	1.8025	1.2675	2.7075	1.2500
1Y	1.8725	-0.75	1.8540	1.8438	1.8148	1.8850	1.2475	2.7450	1.2200
1.5Y	2.0000	-0.25	1.9730	1.9525	1.9120	2.0050	1.2300	2.8100	1.1900
2Y	2.1000	0.00	2.0580	2.0291	1.9818	2.1000	1.2150	2.8850	1.1675
3Y	2.2175	1.00	2.1595	2.1209	2.0640	2.2175	1.2100	3.0275	1.1550
4Y	2.2950	2.00	2.2245	2.1769	2.1165	2.2950	1.2125	3.1450	1.1575
5Y	2.3400	2.50	2.2655	2.2161	2.1516	2.3400	1.2175	3.2400	1.1575
7Y	2.3925	2.50	2.3165	2.2575	2.1883	2.3925	1.2300	3.3800	1.1675
10Y	2.4600	2.75	2.3810	2.3173	2.2436	2.4600	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.4950	2.75	2.4175	2.3579	2.2814	2.4950	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.5075	2.75	2.4310	2.3719	2.2923	2.5075	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.5250	2.75	2.4485	2.3826	2.2946	2.5250	1.2625	3.7325	1.2150
6*9M	7.75	0.00	7.25	6.93	7.39	12.50	-2.75	12.50	-6.00
9*12M	7.75	-0.50	7.85	7.44	7.42	10.50	-2.00	10.50	-4.25
1*2Y	22.75	0.75	20.40	18.54	16.70	22.75	-4.00	22.75	-5.50
2*3Y	11.75	1.00	10.15	9.18	8.22	11.75	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	19.50	2.00	16.65	14.78	13.47	19.50	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	24.00	2.50	20.75	18.70	16.98	24.00	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	7.75	1.00	6.50	5.60	5.25	7.75	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	12.25	1.50	10.60	9.53	8.76	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.50	4.10	3.93	3.51	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	5.25	0.00	5.10	4.14	3.67	10.50	0.75	15.25	0.25
5*10Y	12.00	0.25	11.55	10.11	9.20	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	6.75	0.25	6.45	5.98	5.53	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.00	3.65	4.06	3.78	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	5.00	5.46	4.86	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	6.50	0.00	6.75	6.54	5.10	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.854	0.50	1.829	1.824	1.830	1.885	1.277	2.720	1.237
1.5Y	2.050	0.60	2.017	2.002	1.996	2.050	1.267	2.820	1.232
2Y	2.230	1.00	2.173	2.125	2.098	2.230	1.250	2.920	1.225
3Y	2.306	1.40	2.246	2.188	2.145	2.306	1.231	3.050	1.200
4Y	2.496	1.90	2.425	2.361	2.304	2.496	1.260	3.280	1.232
5Y	2.602	2.70	2.523	2.444	2.364	2.602	1.259	3.410	1.217
7Y	2.728	3.70	2.645	2.569	2.492	2.728	1.325	3.563	1.270
10Y	2.805	5.50	2.708	2.626	2.546	2.805	1.415	3.750	1.355
20Y	2.757	10.00	2.628	2.572	2.510	2.757	1.457	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.65	0.00
CALL	1.50	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.34	-0.05	107.41	107.44	107.25
LKTB	118.75	-0.44	119.26	119.30	118.66

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	1.85	-1.25	2.52	2.02	-1.56	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-5.00	-0.85	-4.38	-4.97	-8.35	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-13.00	-1.00	-11.54	-9.57	-11.62	-1.35	-25.15	5.75	-25.15
3Y	-8.85	-0.40	-8.63	-6.73	-8.13	4.75	-19.50	10.50	-19.50
4Y	-20.10	0.10	-20.01	-18.37	-18.75	-4.70	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-26.20	-0.20	-25.77	-22.75	-21.27	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-33.55	-1.20	-32.87	-31.11	-30.42	-9.40	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-34.50	-2.75	-32.74	-30.91	-30.19	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-23.20	-7.25	-17.93	-18.96	-21.53	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-63.25	0.75
-69.50	1.25
-72.50	0.50
-71.75	-2.00
-70.50	-3.50
-69.50	-4.00
-64.75	-5.00
-57.50	-6.25

CRS

USD/KRW 1073.60 (+8.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2400	0.00	1.6200	0.7650	1*2Y	13.50	0.50
1.5Y	1.3050	1.00	1.6600	0.9150	2*3Y	12.50	-1.50
2Y	1.3750	0.50	1.6950	0.8850	2*5Y	27.00	-2.00
3Y	1.5000	-1.00	1.7550	0.8550	3*4Y	9.00	-0.50
4Y	1.5900	-1.50	1.8000	0.8400	3*5Y	14.50	-0.50
5Y	1.6450	-1.50	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	0.00
7Y	1.7450	-2.50	1.8950	0.8050	5*7Y	10.00	-1.00
10Y	1.8850	-3.50	2.0150	0.7900	5*10Y	24.00	-2.00

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	2.1243	0.0001	2.1242	2.1120	2.0877	2.1243	0.7300	2.1243	0.2800
10Y	2.7212	0.0263	2.6949	2.6640	2.6183	2.7212	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	-10.57	-0.99	-9.58	-4.00	-5.23	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-8.38	-2.87	-5.51	-1.60	-4.17	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	36.00	2.75	33.25	31.50	30.50	41.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	57.50	4.50	53.00	52.80	52.00	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	59.69	2.62	57.07	55.20	53.06	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	
06M	71.75		
09M			
01Y	87.25		
1.5Y	00 / 0.75 / 02		
02Y	11	SPRD	1.5*2y 10.25
03Y	20.5 / 22.5 / 23		3*4y 7.25
04Y			3*5y 11.5 / 12
05Y	32.25 / 33 / 33.5 / 34 / 34.75		4*5y 4.75
07Y	39.25 / 40		5*7y 5.25
10Y			5*8y 7.25
12Y	47		
15Y			
20Y			

CRS	
	1y 24
	2y 38
	3y 50.5

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	183 건	99	84	94	97	94	81	73
금 액	53,815 억원	21,395	32,420	20,523	21,569	29,070	29,390	21,684

장중동향

금리 상승. 국채선물은 상승출발 후 크게 하락. 장중 반등하기도했지만 꾸준한 약세흐름속에 특히 10년선물이 큰폭으로 하락마감.

IRS는 1년을 중심으로 단기쪽은 오퍼리시해 레벨 하락, 3년 뒤로는 상승하며 커브가 큰폭으로 스티프닝. 5년으로 비드가 많이 보이면서 5*10년에 비해 2*5년이 많이 스팀.

CRS는 3년이상으로 레벨이 점차 큰폭으로 하락 커브 플랫 마감.