IPS Daily Morning Brief

2018-01-02

종가 기준일 2017-12-29

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7025	0.25	1.6995	1.6951	1.6028	1.7025	1.2925	2.6925	1.2875
9M	1.7575	-0.25	1.7570	1.7496	1.6848	1.7625	1.2600	2.7275	1.2500
1Y	1.8275	-0.75	1.8305	1.8130	1.7623	1.8350	1.2375	2.7675	1.2200
1.5Y	1.9250	-1.25	1.9295	1.8981	1.8574	1.9375	1.2050	2.8475	1.1900
2Y	1.9950	-2.00	2.0035	1.9561	1.9250	2.0175	1.1850	2.9225	1.1675
3Y	2.0625	-2.50	2.0725	2.0246	2.0065	2.1075	1.1725	3.0650	1.1550
4Y	2.0975	-2.50	2.1095	2.0710	2.0593	2.1600	1.1675	3.1875	1.1575
5Y	2.1275	-2.75	2.1420	2.1035	2.0943	2.1900	1.1675	3.3050	1.1575
7Y	2.1550	-3.25	2.1720	2.1358	2.1327	2.2300	1.1750	3.4625	1.1675
10Y	2.2000	-3.25	2.2185	2.1881	2.1885	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2350	-3.25	2.2540	2.2251	2.2225	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2475	-3.25	2.2675	2.2379	2.2321	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2475	-3.25	2.2670	2.2359	2.2347	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.50	-0.50	5.75	5.45	8.20	12.50	-3.50	12.50	-6.00
9*12M	7.00	-0.50	7.35	6.34	7.75	10.50	-2.50	10.50	-4.25
1*2Y	16.75	-1.25	17.30	14.31	16.27	20.75	-5.25	20.75	-5.50
2*3Y	6.75	-0.50	6.90	6.85	8.15	11.00	-1.25	15.00	-1.75
2*4Y	10.25	-0.50	10.60	11.49	13.43	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	13.25	-0.75	13.85	14.74	16.93	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	3.50	0.00	3.70	4.64	5.28	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	6.50	-0.25	6.95	7.89	8.78	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.00	-0.25	3.25	3.25	3.50	6.25	0.00	11.75	-0.25
5*7Y	2.75	-0.50	3.00	3.23	3.84	10.50	0.25	16.00	0.25
5*10Y	7.25	-0.50	7.65	8.46	9.43	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	4.50	0.00	4.65	5.24	5.58	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.00	3.55	3.70	3.40	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.90	4.98	4.36	5.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.75	0.00	4.85	4.78	4.62	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.846	-2.60	1.865	1.843	1.799	1.885	1.252	2.720	1.237
1.5Y	2.014	-1.70	2.019	1.976	1.950	2.037	1.240	2.820	1.232
2Y	2.090	-3.00	2.107	2.064	2.042	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.133	-1.90	2.138	2.099	2.091	2.206	1.202	3.050	1.200
4Y	2.295	-2.00	2.295	2.243	2.249	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.347	-2.00	2.349	2.298	2.298	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.446	-2.90	2.459	2.424	2.433	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.467	-3.50	2.490	2.472	2.490	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.450	-1.00	2.450	2.440	2.459	2.572	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.66	0.00
CALL	1.50	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.89	0.06	107.88	107.94	107.85
LKTB	121.90	0.40	121.79	121.94	121.63

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	1.85	-3.47	-3.05	-3.70	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-8.90	0.45	-8.97	-7.77	-9.30	2.40	-19.10	8.50	-19.10
2Y	-9.50	1.00	-10.39	-10.83	-11.68	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-7.05	-0.60	-6.55	-7.41	-8.46	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-19.75	-0.50	-18.53	-17.23	-18.96	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-21.95	-0.75	-20.72	-19.45	-20.35	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.10	-0.35	-28.74	-28.81	-29.98	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-26.70	0.25	-27.17	-28.41	-30.10	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-20.25	-2.25	-18.32	-20.42	-22.46	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-45.25	6.25
-50.50	3.75
-52.50	2.00
-49.75	2.00
-47.75	2.00
-47.25	1.25
-44.50	1.75
-36.00	1.75

CRS

USD/KRW 1070.50 (0.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3750	5.50	1.6200	0.7650	1*2Y	9.50	-5.50
1.5Y	1.4200	2.50	1.6600	1.0350	2*3Y	9.50	-0.50
2Y	1.4700	0.00	1.6950	0.9650	2*5Y	18.50	-1.50
3Y	1.5650	-0.50	1.7550	0.8550	3*4Y	5.50	0.00
4Y	1.6200	-0.50	1.8000	0.8400	3*5Y	9.00	-1.00
5Y	1.6550	-1.50	1.8500	0.8250	4*5Y	3.50	-1.00
7Y	1.7100	-1.50	1.8950	0.8050	5*7Y	5.50	0.00
10Y	1.8400	-1.50	2.0150	0.7900	5*10Y	18.50	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	1.8870	-0.0202	1.9072	1.8912	1.9033	1.9072	0.6460	1.9072	0.2800
10Y	2.4101	-0.0242	2.4343	2.4108	2.4776	2.6060	1.4520	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	-20.30	0.98	-21.28	-22.88	-20.37	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-5.69	1.08	-6.77	-9.12	-1.24	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	20.50	-1.25	21.75	21.75	22.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	37.70	-0.50	38.20	38.20	38.30	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	52.31	-0.40	52.71	51.96	57.43	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	70.25	ODD Tenor	
09M			
01Y	83.5		
1.5Y			
02Y		SPRD	2*10y 20.5
03Y			5*10y 07
04Y			
05Y	14.25		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	41 건	-17	58	58	43	59	43	69
금 액	10,235 억원	-6,430	16,665	16,665	8,723	16,160	13,790	19,560

장중동향

마지막 거래일 국고채 금리, 전일 금리 상승 되돌림으로 하락 마감.

IRS, 장기물을 중심으로 금리가 하락하면서 커브 플래트닝.
국채선물이 오르면서 오퍼가 많이 나왔으나 그래는 그다지 활발하지 않음.

CRS, 1Y-2Y 구간을 제외한 전 구간에서 금리 하락.
전일 FX스왑이 떨어졌다 회복한 영향으로 CRS 1Y 구간만 급등.