IPS Daily Morning Brief

2018-01-29

종가 기준일 2018-01-26

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6975	0.50	1.6895	1.6983	1.6612	1.7200	1.2925	2.6825	1.2875
9M	1.7675	0.50	1.7570	1.7650	1.7363	1.8025	1.2650	2.7175	1.2500
1Y	1.8450	0.50	1.8360	1.8383	1.8109	1.8850	1.2450	2.7575	1.2200
1.5Y	1.9625	0.75	1.9505	1.9440	1.9077	2.0050	1.2275	2.8300	1.1900
2Y	2.0400	1.00	2.0265	2.0178	1.9768	2.0825	1.2100	2.9100	1.1675
3Y	2.1325	1.00	2.1220	2.1054	2.0583	2.1775	1.2075	3.0275	1.1550
4Y	2.1950	1.50	2.1825	2.1578	2.1102	2.2300	1.2125	3.1450	1.1575
5Y	2.2350	1.50	2.2225	2.1961	2.1451	2.2650	1.2175	3.2400	1.1575
7Y	2.2900	2.00	2.2695	2.2354	2.1814	2.2950	1.2300	3.3800	1.1675
10Y	2.3550	2.00	2.3330	2.2933	2.2363	2.3550	1.2675	3.5250	1.2125
12Y	2.3900	2.00	2.3725	2.3339	2.2737	2.3950	1.2725	3.5600	1.2150
15Y	2.4025	1.75	2.3870	2.3479	2.2844	2.4100	1.2725	3.5825	1.2150
20Y	2.4200	1.75	2.4045	2.3569	2.2864	2.4200	1.2625	3.7325	1.2150

6*9M	7.00	0.00	6.75	6.68	7.51	12.50	-2.75	12.50	-6.00
9*12M	7.75	0.00	7.90	7.33	7.46	10.50	-2.00	10.50	-4.25
1*2Y	19.50	0.50	19.05	17.95	16.59	20.75	-4.00	20.75	-5.50
2*3Y	9.25	0.00	9.55	8.76	8.15	11.00	-0.75	14.25	-1.75
2*4Y	15.50	0.50	15.60	14.00	13.34	18.00	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	19.50	0.50	19.60	17.84	16.83	21.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	6.25	0.50	6.05	5.24	5.19	7.75	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.50	10.05	9.07	8.68	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.00	4.00	3.84	3.49	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	5.50	0.50	4.70	3.93	3.63	10.50	0.75	15.25	0.25
5*10Y	12.00	0.50	11.05	9.71	9.12	22.25	4.25	30.75	3.75
7*10Y	6.50	0.00	6.35	5.79	5.49	12.75	3.25	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.00	3.95	4.06	3.74	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	-0.25	5.40	5.46	4.81	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	6.50	-0.25	7.15	6.36	5.01	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.815	0.20	1.814	1.822	1.830	1.885	1.275	2.720	1.237
1.5Y	2.000	0.50	1.997	1.998	1.994	2.040	1.260	2.820	1.232
2Y	2.152	1.20	2.133	2.111	2.093	2.170	1.247	2.920	1.225
3Y	2.222	1.00	2.205	2.171	2.140	2.230	1.227	3.050	1.200
4Y	2.400	1.60	2.376	2.341	2.298	2.406	1.255	3.280	1.232
5Y	2.495	1.30	2.471	2.419	2.357	2.495	1.252	3.410	1.217
7Y	2.618	1.60	2.596	2.542	2.485	2.618	1.324	3.563	1.270
10Y	2.680	2.00	2.657	2.597	2.537	2.680	1.415	3.750	1.355
20Y	2.600	3.00	2.581	2.548	2.503	2.608	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	107.63	-0.03	107.70	107.72	107.61
LKTB	119.88	-0.18	120.33	120.33	119.86

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	3.00	0.30	2.20	1.67	-1.89	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-3.75	0.25	-4.65	-5.37	-8.65	2.40	-19.10	7.00	-19.10
2Y	-11.20	-0.20	-10.61	-9.29	-11.66	-1.35	-25.15	6.50	-25.15
3Y	-8.95	0.00	-8.26	-6.53	-8.15	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-20.50	-0.10	-19.35	-18.28	-18.82	-3.50	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-26.00	0.20	-24.87	-22.28	-21.18	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.80	0.40	-32.69	-30.70	-30.36	-8.70	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.50	0.00	-32.44	-30.33	-30.09	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-18.00	-1.25	-17.69	-19.08	-21.63	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-65.50	2.00
-70.25	0.25
-70.50	-0.50
-65.75	-1.50
-61.00	-2.00
-59.50	-2.50
-55.00	-2.50
-47.00	-2.50

CRS

USD/KRW 1063.90 (+5.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1900	2.50	1.6200	0.7650	1*2Y	14.50	-2.00
1.5Y	1.2600	1.00	1.6600	0.9200	2*3Y	14.00	-1.00
2Y	1.3350	0.50	1.6950	0.8850	2*5Y	30.50	-1.50
3Y	1.4750	-0.50	1.7550	0.8550	3*4Y	11.00	0.00
4Y	1.5850	-0.50	1.8000	0.8400	3*5Y	16.50	-0.50
5Y	1.6400	-1.00	1.8500	0.8350	4*5Y	5.50	-0.50
7Y	1.7400	-0.50	1.8950	0.8050	5*7Y	10.00	0.50
10Y	1.8850	-0.50	2.0150	0.7900	5*10Y	24.50	0.50

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	2.1120	0.0243	2.0877	2.0796	2.0241	2.1120	0.7300	2.1120	0.2800
10Y	2.6640	0.0457	2.6183	2.6488	2.6153	2.6640	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	-4.00	1.23	-5.23	-4.54	-9.59	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-1.60	2.57	-4.17	0.18	-2.97	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	31.50	1.00	30.50	30.25	30.50	41.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	52.80	0.80	52.00	52.20	52.50	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	55.20	2.14	53.06	56.92	59.12	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	8Y 31.25
06M			
09M			
01Y	83.75		
1.5Y			
02Y	3.75	SPRD	7*8Y 02
03Y	11.75 / 12		2*3Y 9.25
04Y			5*10Y 12
05Y	21.75 / 22.25 / 24 / 23.75		5*8Y 7.5
07Y			15*20Y 4.75
10Y	34.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	94 건	-3	97	94	81	73	191	139
금 액	20,523 억원	-1,046	21,569	29,070	29,390	21,684	55,197	47,815

장중동향

국고채 금리, 상승 마감.
장중 강세를 보였던 금리는 다음 주 국고채 20년물 입찰 부담감을 이기지 못했음. 단기물 강보합.

IRS 금리 상승 마감. 커브 스티프닝.
특히 5년 위주로 비드가 상당히 많이 나옴.

CRS 금리 혼조세. 2년 이하 구간은 오르고 나머지 구간은 내려 커브 플래트닝.