IPS Daily Morning Brief

2018-01-08

종가 기준일 2018-01-05

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6950	-0.25	1.6980	1.6960	1.6177	1.7025	1.2925	2.6875	1.2875
9M	1.7550	-0.25	1.7530	1.7520	1.6991	1.7625	1.2600	2.7225	1.2500
1Y	1.8200	-0.25	1.8195	1.8173	1.7763	1.8350	1.2375	2.7675	1.2200
1.5Y	1.9100	-0.50	1.9125	1.9054	1.8714	1.9375	1.2050	2.8425	1.1900
2Y	1.9800	-0.75	1.9835	1.9663	1.9393	2.0175	1.1900	2.9200	1.1675
3Y	2.0575	-1.50	2.0600	2.0350	2.0201	2.1075	1.1850	3.0575	1.1550
4Y	2.1075	-1.00	2.1020	2.0789	2.0723	2.1600	1.1825	3.1725	1.1575
5Y	2.1425	-1.50	2.1385	2.1118	2.1070	2.1900	1.1825	3.2750	1.1575
7Y	2.1800	-1.50	2.1735	2.1434	2.1443	2.2300	1.1850	3.4350	1.1675
10Y	2.2350	-1.75	2.2255	2.1941	2.1984	2.2850	1.2200	3.5975	1.2125
12Y	2.2750	-1.25	2.2615	2.2309	2.2326	2.3200	1.2225	3.6300	1.2150
15Y	2.2875	-1.25	2.2740	2.2446	2.2422	2.3275	1.2225	3.6375	1.2150
20Y	2.2900	-1.00	2.2745	2.2433	2.2443	2.3250	1.2225	3.7850	1.2150

6*9M	6.00	0.00	5.50	5.60	8.14	12.50	-3.50	12.50	-6.00
9*12M	6.50	0.00	6.65	6.53	7.72	10.50	-2.50	10.50	-4.25
1*2Y	16.00	-0.50	16.40	14.90	16.30	20.75	-4.75	20.75	-5.50
2*3Y	7.75	-0.75	7.65	6.87	8.08	11.00	-1.00	15.00	-1.75
2*4Y	12.75	-0.25	11.85	11.26	13.30	18.00	-0.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.25	-0.75	15.50	14.55	16.77	21.25	-0.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.50	4.20	4.39	5.22	7.75	-0.25	14.00	-0.50
3*5Y	8.50	0.00	7.85	7.68	8.68	14.00	-0.25	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	-0.50	3.65	3.29	3.46	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	3.75	0.00	3.50	3.16	3.73	10.50	0.25	16.00	0.25
5*10Y	9.25	-0.25	8.70	8.24	9.15	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	5.50	-0.25	5.20	5.08	5.42	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.50	3.60	3.68	3.42	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.50	4.85	5.05	4.38	5.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.50	0.75	4.90	4.91	4.59	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.801	-0.90	1.816	1.838	1.814	1.885	1.252	2.720	1.237
1.5Y	1.970	-1.20	1.987	1.980	1.967	2.037	1.240	2.820	1.232
2Y	2.062	-1.90	2.076	2.070	2.059	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.092	-4.80	2.121	2.103	2.105	2.206	1.210	3.050	1.200
4Y	2.278	-2.20	2.286	2.252	2.263	2.360	1.237	3.280	1.232
5Y	2.337	-2.30	2.344	2.310	2.313	2.420	1.225	3.410	1.217
7Y	2.458	-2.00	2.458	2.430	2.443	2.552	1.281	3.563	1.270
10Y	2.515	-1.50	2.502	2.475	2.497	2.607	1.367	3.750	1.355
20Y	2.510	0.00	2.486	2.452	2.467	2.572	1.442	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	107.95	0.08	107.88	107.96	107.86
LKTB	121.39	0.15	121.33	121.43	121.22

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	1.90	0.65	0.37	-2.07	-3.73	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-6.00	0.70	-7.47	-7.42	-9.51	2.40	-19.10	7.25	-19.10
2Y	-8.20	1.15	-9.25	-10.39	-11.92	-1.35	-25.15	6.50	-25.15
3Y	-3.45	3.30	-6.10	-6.82	-8.46	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-17.05	1.20	-18.42	-17.30	-19.06	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-19.45	0.80	-20.57	-19.82	-20.63	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-27.80	0.50	-28.45	-28.69	-29.92	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-28.00	-0.25	-27.63	-28.13	-29.83	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-22.00	-1.00	-21.19	-20.88	-22.27	-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 (+0.50)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3250	1.50	1.6200	0.7650	1*2Y	16.00	-0.50
1.5Y	1.4050	1.00	1.6600	1.0500	2*3Y	13.00	1.00
2Y	1.4850	1.00	1.6950	0.9850	2*5Y	23.50	0.00
3Y	1.6150	2.00	1.7550	0.8550	3*4Y	6.50	0.00
4Y	1.6800	2.00	1.8000	0.8400	3*5Y	10.50	-1.00
5Y	1.7200	1.00	1.8500	0.8350	4*5Y	4.00	-1.00
7Y	1.7750	1.00	1.8950	0.8050	5*7Y	5.50	0.00
10Y	1.9050	1.00	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	1.9602	0.0084	1.9518	1.9355	1.9274	1.9602	0.6460	1.9602	0.2800
10Y	2.4774	0.0247	2.4527	2.4500	2.4626	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	-10.18	2.74	-12.92	-13.65	-14.76	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-3.76	3.97	-7.73	-5.50	-2.94	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	25.50	-1.00	26.50	25.00	23.50	41.50	3.00	70.25	2.75
KTB 2*10Y	45.30	0.40	44.90	43.30	41.70	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	51.72	1.63	50.09	51.45	53.52	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	8y 21
06M			
09M			
01Y	82		
1.5Y	90.75 / 91		
02Y		SPRD	3*4y 4.75
03Y	6.5 / 07		3*20y 23
04Y	11.75		5*8y 5.25
05Y	15 / 15.75		5*10y 9.25
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3y 61.5 5y 73		

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	107 건	3	104	111	76	0	41	58
금 액	31,906 억원	1,849	30,057	25,829	20,776	0,000	10,235	16,665

장중동향

채권은 강세를 보이며 금리하락, 커브 스팁 마감. 외국인의 3년물 매수가 집중되면서 3년 금리가 크게 하락.

IRS는 현물대비 상대적으로 비디시했으나 채권 강세에 연동해 레벨 하락.

CRS는 전구간 상승 마감.