

IPS Daily Morning Brief

2018-01-10

종가 기준일 2018-01-09

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7075	0.50	1.7000	1.6973	1.6255	1.7075	1.2925	2.6875	1.2875
9M	1.7750	0.75	1.7605	1.7544	1.7068	1.7750	1.2650	2.7225	1.2500
1Y	1.8400	0.75	1.8255	1.8206	1.7840	1.8400	1.2425	2.7675	1.2200
1.5Y	1.9400	1.00	1.9200	1.9108	1.8794	1.9400	1.2150	2.8425	1.1900
2Y	2.0125	1.50	1.9910	1.9735	1.9476	2.0175	1.2000	2.9200	1.1675
3Y	2.0950	1.75	2.0715	2.0429	2.0283	2.1075	1.1975	3.0575	1.1550
4Y	2.1450	1.75	2.1190	2.0866	2.0804	2.1600	1.1975	3.1725	1.1575
5Y	2.1850	2.00	2.1575	2.1198	2.1148	2.1900	1.2025	3.2750	1.1575
7Y	2.2250	2.00	2.1960	2.1518	2.1516	2.2300	1.2100	3.4350	1.1675
10Y	2.2825	2.25	2.2515	2.2021	2.2050	2.2850	1.2500	3.5975	1.2125
12Y	2.3225	2.25	2.2895	2.2391	2.2395	2.3225	1.2525	3.6300	1.2150
15Y	2.3350	2.25	2.3020	2.2533	2.2491	2.3350	1.2525	3.6375	1.2150
20Y	2.3375	2.25	2.3035	2.2524	2.2508	2.3375	1.2525	3.7850	1.2150

6*9M	6.75	0.25	6.05	5.71	8.13	12.50	-3.25	12.50	-6.00
9*12M	6.50	0.00	6.50	6.63	7.72	10.50	-2.25	10.50	-4.25
1*2Y	17.25	0.75	16.55	15.29	16.36	20.75	-4.50	20.75	-5.50
2*3Y	8.25	0.25	8.05	6.94	8.08	11.00	-1.00	14.50	-1.75
2*4Y	13.25	0.25	12.80	11.31	13.28	18.00	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	17.25	0.50	16.65	14.63	16.72	21.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	4.75	4.38	5.20	7.75	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	9.00	0.25	8.60	7.69	8.65	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.25	3.85	3.31	3.44	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	4.00	0.00	3.85	3.20	3.68	10.50	0.75	16.00	0.25
5*10Y	9.75	0.25	9.40	8.24	9.03	22.25	4.00	32.25	3.75
7*10Y	5.75	0.25	5.55	5.04	5.34	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	3.80	3.70	3.45	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.25	0.00	5.05	5.11	4.41	5.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.50	0.00	5.20	5.03	4.58	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.811	0.00	1.808	1.835	1.820	1.885	1.252	2.720	1.237
1.5Y	1.980	0.30	1.978	1.981	1.974	2.037	1.240	2.820	1.232
2Y	2.090	1.50	2.076	2.073	2.067	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.152	2.20	2.128	2.108	2.113	2.206	1.212	3.050	1.200
4Y	2.317	2.70	2.293	2.259	2.271	2.360	1.242	3.280	1.232
5Y	2.387	3.20	2.356	2.318	2.322	2.420	1.240	3.410	1.217
7Y	2.510	3.20	2.477	2.437	2.450	2.552	1.300	3.563	1.270
10Y	2.570	3.30	2.531	2.482	2.502	2.607	1.390	3.750	1.355
20Y	2.535	0.00	2.516	2.461	2.472	2.572	1.451	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	107.84	-0.06	107.90	107.90	107.83
LKTb	120.80	-0.33	121.10	121.12	120.80

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	2.90	0.75	1.79	-1.48	-3.58	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-4.00	0.70	-5.78	-7.07	-9.46	2.40	-19.10	7.25	-19.10
2Y	-7.75	0.00	-8.50	-9.96	-11.91	-1.35	-25.15	6.50	-25.15
3Y	-5.70	-0.45	-5.63	-6.49	-8.44	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-17.20	-0.95	-17.44	-17.19	-19.05	-3.20	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-20.20	-1.20	-19.87	-19.84	-20.73	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-28.50	-1.20	-28.06	-28.55	-29.87	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-28.75	-1.05	-27.99	-28.01	-29.73	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-19.75	2.25	-21.25	-20.86	-22.14	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1067.10 (+1.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-45.25	0.00	1Y	1.3050	0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	16.00	-1.50		
-50.50	0.00	1.5Y	1.3850	0.50	1.6600	1.0200	2*3Y	13.00	-0.50		
-52.50	0.00	2Y	1.4650	-1.00	1.6950	0.9700	2*5Y	23.50	-1.00		
-49.75	0.00	3Y	1.5950	-1.50	1.7550	0.8550	3*4Y	5.50	-0.50		
-47.75	0.00	4Y	1.6500	-2.00	1.8000	0.8400	3*5Y	10.50	-0.50		
-47.25	0.00	5Y	1.7000	-2.00	1.8500	0.8350	4*5Y	5.00	0.00		
-44.50	0.00	7Y	1.7450	-3.00	1.8950	0.8050	5*7Y	4.50	-1.00		
-36.00	0.00	10Y	1.8700	-3.00	2.0150	0.7900	5*10Y	17.00	-1.00		

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	1.9767	0.0124	1.9643	1.9602	1.9518	1.9767	0.6460	1.9767	0.2800
10Y	2.5553	0.0749	2.4804	2.4774	2.4527	2.6060	1.5020	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	-11.33	-0.26	-11.07	-10.18	-12.92	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-1.47	4.19	-5.66	-3.76	-7.73	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	27.00	0.75	26.25	25.50	26.50	41.50	3.50	68.25	2.75
KTb 2*10Y	48.00	1.80	46.20	45.30	44.90	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	57.86	6.25	51.61	51.72	50.09	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M									
09M									
01Y	84								
1.5Y	93.75 / 94								
02Y									
03Y	8								
04Y									
05Y	17.25 / 17.5 / 18.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	101 건	10	91	107	104	111	76	0	
금 액	32,135 억원	-4,775	36,910	31,906	30,057	25,829	20,776	0,000	

장중동향

채권은 금리 상승, 커브 스티프닝. 국고채 30년물 입찰호조에 초장기만 강세.

IRS는 채권과 연동해 레벨이 상승. 아웃라잇 단기쪽은 비디시, 중기물은 오퍼가 많았고, 거래는 5년쪽을 중심으로 많이 보임.

CRS는 1년 구간을 제외하고 모두 하락.