IPS Daily Morning Brief

2018-01-16

종가 기준일 2018-01-15

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7200	0.50	1.7100	1.7008	1.6393	1.7200	1.2925	2.6875	1.2875
9M	1.8025	1.50	1.7825	1.7618	1.7197	1.8025	1.2650	2.7225	1.2500
1Y	1.8850	3.25	1.8540	1.8309	1.7970	1.8850	1.2450	2.7675	1.2200
1.5Y	2.0050	5.00	1.9605	1.9266	1.8937	2.0050	1.2275	2.8425	1.1900
2Y	2.0825	5.50	2.0340	1.9948	1.9627	2.0825	1.2025	2.9200	1.1675
3Y	2.1775	6.00	2.1245	2.0689	2.0443	2.1775	1.1975	3.0575	1.1550
4Y	2.2300	5.50	2.1785	2.1145	2.0966	2.2300	1.2050	3.1725	1.1575
5Y	2.2650	5.25	2.2170	2.1483	2.1308	2.2650	1.2075	3.2750	1.1575
7Y	2.2950	4.25	2.2560	2.1820	2.1670	2.2950	1.2150	3.4350	1.1675
10Y	2.3500	3.75	2.3145	2.2338	2.2201	2.3500	1.2525	3.5975	1.2125
12Y	2.3950	3.75	2.3580	2.2721	2.2553	2.3950	1.2550	3.6300	1.2150
15Y	2.4100	3.75	2.3725	2.2868	2.2651	2.4100	1.2575	3.6375	1.2150
20Y	2.4200	4.00	2.3780	2.2876	2.2664	2.4200	1.2575	3.7850	1.2150
6*9M	8.25	1.00	7.25	6.10	8.04	12.50	-3.00	12.50	-6.00
9*12M	8.25	1.75	7.15	6.91	7.73	10.50	-2.00	10.50	-4.25
1*2Y	19.75	2.25	18.00	16.39	16.58	20.75	-4.50	20.75	-5.50
2*3Y	9.50	0.50	9.05	7.41	8.15	11.00	-1.00	14.25	-1.75
2*4Y	14.75	0.00	14.45	11.98	13.39	18.00	-0.75	27.75	-1.75
2*5Y	18.25	-0.25	18.30	15.35	16.80	21.25	-0.75	38.50	-1.75
3*4Y	5.25	-0.50	5.40	4.56	5.24	7.75	0.00	14.00	-0.50
3*5Y	8.75	-0.75	9.25	7.94	8.65	14.00	0.00	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	-0.25	3.85	3.38	3.41	6.25	0.00	11.25	-0.25
5*7Y	3.00	-1.00	3.90	3.38	3.63	10.50	0.75	16.00	0.25
5*10Y	8.50	-1.50	9.75	8.55	8.93	22.25	4.00	32.25	3.75
7*10Y	5.50	-0.50	5.85	5.18	5.31	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.50	0.00	4.35	3.84	3.53	4.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	6.00	0.00	5.80	5.30	4.50	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.00	0.25	6.35	5.39	4.63	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.853	2.90	1.828	1.838	1.830	1.885	1.252	2.720	1.237
1.5Y	2.040	4.90	1.999	1.993	1.988	2.040	1.240	2.820	1.232
2Y	2.170	6.30	2.116	2.089	2.083	2.170	1.225	2.920	1.225
3Y	2.230	6.30	2.175	2.128	2.128	2.230	1.212	3.050	1.200
4Y	2.406	6.10	2.350	2.286	2.287	2.406	1.242	3.280	1.232
5Y	2.485	5.80	2.432	2.351	2.341	2.485	1.240	3.410	1.217
7Y	2.612	5.30	2.558	2.470	2.467	2.612	1.300	3.563	1.270
10Y	2.661	4.40	2.614	2.515	2.517	2.661	1.392	3.750	1.355
20Y	2.574	2.10	2.557	2.484	2.484	2.580	1.451	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.66	0.00
CALL	1.50	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.54	-0.21	107.73	107.73	107.54
LKTB	119.86	-0.47	120.33	120.40	119.84

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	3.20	0.35	2.64	-0.68	-3.33	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-3.50	0.10	-3.83	-6.68	-9.48	2.40	-19.10	7.25	-19.10
2Y	-8.75	-0.80	-8.24	-9.39	-12.05	-1.35	-25.15	6.50	-25.15
3Y	-5.25	-0.30	-5.07	-5.93	-8.35	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-17.60	-0.60	-17.11	-17.18	-19.08	-3.20	-30.35	2.00	-30.35
5Y	-22.00	-0.55	-21.46	-20.26	-21.03	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.70	-1.05	-30.16	-28.78	-30.00	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.10	-0.65	-29.91	-28.14	-29.69	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-15.40	1.90	-17.94	-19.68	-21.73	-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 (-2.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2800	0.00	1.6200	0.7650	1*2Y	17.50	1.50
1.5Y	1.3750	1.00	1.6600	0.9800	2*3Y	15.50	0.50
2Y	1.4550	1.50	1.6950	0.9350	2*5Y	31.50	1.50
3Y	1.6100	2.00	1.7550	0.8550	3*4Y	8.50	0.50
4Y	1.6950	2.50	1.8000	0.8400	3*5Y	16.00	1.00
5Y	1.7700	3.00	1.8500	0.8350	4*5Y	7.50	0.50
7Y	1.8200	3.00	1.8950	0.8050	5*7Y	5.00	0.00
10Y	1.9500	3.00	2.0150	0.7900	5*10Y	18.00	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	2.0062	0.0000	2.0062	1.9687	1.9768	2.0062	0.6860	2.0062	0.2800
10Y	2.5484	0.0000	2.5484	2.5380	2.5563	2.6060	1.5050	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	-16.38	-6.3	-10.08	-13.13	-13.82	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-11.26	-4.40	-6.86	-5.20	-7.37	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	26.75	-1.75	28.50	28.25	29.75	41.50	3.50	68.25	2.75
KTB 2*10Y	49.10	-1.90	51.00	49.00	51.50	68.70	12.50	89.00	11.80
UST 2*10Y	54.22	0.00	54.22	56.93	57.95	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	88.5		
1.5Y	98.25 / 0.5		
02Y	04 / 7.5	SPRD	1*2Y 19.5
03Y	13.25		2*3Y 9.25 / 9.5
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	33.5 / 33.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	88 건	-20	108	117	211	101	91	107
금 액	31,285 억원	-17,088	48,373	40,448	71,572	32,135	36,910	31,906

장중동향

국고채 금리 상승. 외인이 이번주 금통위를 앞두고 3년 국채선물 매도.
지난주 주요국 중앙은행들의 긴축 시사도 영향.

IRS, 국채선물에 연동되며 금리 상승.
오전부터 단기 구간을 중심으로 비디쉬한 분위기. 본드스왑 스프레드 확대.

CRS, 1년을 제외한 모든 구간에서 금리 상승.
6개월 테너로 에셋스왑 롤 물량이 지속적으로 나오고, 장기구간은 부채스왑 기대감으로 금리가 오르는 모습.