IPS Daily Morning Brief

2017-12-19

종가 기준일 2017-12-18

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7000	0.75	1.6940	1.6644	1.5725	1.7000	1.2875	2.6925	1.2875
9M	1.7575	0.75	1.7495	1.7309	1.6552	1.7575	1.2550	2.7275	1.2500
1Y	1.8250	0.75	1.8125	1.7979	1.7324	1.8250	1.2300	2.7675	1.2200
1.5Y	1.9100	1.00	1.8940	1.8803	1.8260	1.9300	1.2050	2.8475	1.1900
2Y	1.9625	1.50	1.9420	1.9361	1.8923	2.0175	1.1850	2.9225	1.1675
3Y	2.0175	1.50	2.0040	2.0119	1.9765	2.1075	1.1725	3.0650	1.1550
4Y	2.0625	1.75	2.0485	2.0644	2.0305	2.1600	1.1675	3.1875	1.1575
5Y	2.0850	1.50	2.0790	2.0989	2.0669	2.1900	1.1675	3.3050	1.1575
7Y	2.1125	1.50	2.1075	2.1334	2.1077	2.2300	1.1750	3.4625	1.1675
10Y	2.1575	1.50	2.1555	2.1893	2.1674	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.1950	1.50	2.1930	2.2269	2.2009	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2125	1.50	2.2080	2.2355	2.2101	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2100	1.50	2.2055	2.2326	2.2139	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.75	0.00	5.55	6.65	8.28	12.50	-3.50	12.50	-6.00
9*12M	6.75	0.00	6.30	6.70	7.72	10.50	-2.50	10.50	-4.25
1*2Y	13.75	0.75	12.95	13.83	15.99	20.75	-5.25	20.75	-5.50
2*3Y	5.50	0.00	6.20	7.58	8.43	11.00	-1.25	15.00	-1.75
2*4Y	10.00	0.25	10.65	12.83	13.83	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	12.25	0.00	13.70	16.28	17.47	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	4.50	0.25	4.45	5.25	5.40	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	6.75	0.00	7.50	8.70	9.04	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	2.25	-0.25	3.05	3.45	3.64	6.25	0.00	11.75	-0.25
5*7Y	2.75	0.00	2.85	3.45	4.08	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	7.25	0.00	7.65	9.04	10.05	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	4.50	0.00	4.80	5.59	5.98	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.76	3.35	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.25	4.62	4.26	5.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.00	5.00	4.34	4.65	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.861	1.20	1.834	1.836	1.760	1.885	1.252	2.720	1.237
1.5Y	1.985	1.40	1.956	1.979	1.912	2.037	1.240	2.820	1.232
2Y	2.075	2.00	2.053	2.063	2.004	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.087	1.60	2.078	2.106	2.060	2.206	1.202	3.050	1.200
4Y	2.215	2.00	2.209	2.251	2.218	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.272	2.00	2.268	2.298	2.264	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.391	1.20	2.394	2.431	2.409	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.433	0.30	2.445	2.487	2.475	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.411	-1.80	2.431	2.462	2.449	2.572	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.66	0.00
CALL	1.48	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.28	-0.06	108.33	108.35	108.27
LKTB	122.57	-0.08	122.65	122.78	122.56

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	-3.60	-0.45	-2.17	-3.78	-2.73	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-7.50	-0.40	-6.24	-9.90	-8.59	2.40	-19.10	8.50	-19.10
2Y	-11.25	-0.50	-11.06	-12.71	-11.13	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-6.95	-0.10	-7.40	-9.38	-8.30	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-15.25	-0.25	-16.09	-18.65	-18.72	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-18.70	-0.50	-18.92	-19.87	-19.70	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-27.85	0.30	-28.67	-29.75	-30.10	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-27.55	1.20	-28.91	-29.77	-30.76	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-20.10	3.30	-22.55	-22.98	-23.50	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-54.50	-1.75
-57.00	-2.00
-58.25	-2.50
-57.25	-2.50
-56.75	-2.25
-54.50	-2.00
-52.25	-2.00
-44.25	-2.00

CRS

USD/KRW 1088.50 (-1.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2800	-1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	10.00	0.00
1.5Y	1.3400	-1.00	1.6600	0.9850	2*3Y	6.50	0.00
2Y	1.3800	-1.00	1.6950	0.9050	2*5Y	16.00	0.50
3Y	1.4450	-1.00	1.7550	0.8500	3*4Y	5.00	0.50
4Y	1.4950	-0.50	1.8000	0.8100	3*5Y	9.50	0.50
5Y	1.5400	-0.50	1.8500	0.7850	4*5Y	4.50	0.00
7Y	1.5900	-0.50	1.8950	0.7900	5*7Y	5.00	0.00
10Y	1.7150	-0.50	2.0150	0.7650	5*10Y	17.50	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	1.8277	-0.0122	1.8399	1.8110	1.7783	1.8399	0.6460	1.8399	0.2800
10Y	2.3926	0.0350	2.3576	2.3531	2.3433	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	-24.73	-3.22	-21.51	-24.50	-26.17	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-4.04	3.20	-7.24	-9.69	-11.17	47.40	-24.46	47.40	-100.00

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	19.50	0.00	19.50	21.50	22.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	35.80	-1.70	37.50	39.40	41.50	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	56.49	4.72	51.77	54.21	56.50	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y		SPRD	1.5*2Y 05
03Y	00		1.5*3Y 10.25
04Y			2*4Y 10
05Y	6.75		7*10y 4.25 / 4.5
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	50 건	-65	115	91	85	97	31	66
금 액	12,060 억원	-22,694	34,754	43,501	26,871	23,087	7,700	26,050

장중동향

국고채 금리, 단기물 금리 상승 & 장기물 금리 하락으로 커브 플래트닝.
국고 20년물 입찰은 실수요가 유입되면서 호조를 보인 반면, 통안채 입찰은 물량 미달 등 부진.

IRS, 국채선물이 장 후반 하락하면서 IRS도 영향을 받아 금리 상승 마감.
한산한 분위기 속에 거래가 많지는 않았으나, 2Y~5Y 구간에서 오퍼가 유입되며 간간이 거래.

CRS, 전구간 금리 하락.