

IPS Daily Morning Brief

2017-12-15

종가 기준일 2017-12-14

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6950	0.25	1.6935	1.6553	1.5641	1.7000	1.2875	2.6925	1.2875
9M	1.7475	0.00	1.7480	1.7265	1.6466	1.7500	1.2550	2.7275	1.2500
1Y	1.8175	1.50	1.8060	1.7958	1.7232	1.8200	1.2300	2.7675	1.2200
1.5Y	1.9000	1.75	1.8855	1.8791	1.8162	1.9300	1.2050	2.8475	1.1900
2Y	1.9450	1.50	1.9330	1.9374	1.8824	2.0175	1.1825	2.9225	1.1675
3Y	2.0025	0.25	2.0030	2.0163	1.9673	2.1075	1.1700	3.0650	1.1550
4Y	2.0500	0.75	2.0495	2.0703	2.0214	2.1600	1.1675	3.1875	1.1575
5Y	2.0850	0.75	2.0850	2.1055	2.0581	2.1900	1.1675	3.3050	1.1575
7Y	2.1125	0.50	2.1160	2.1410	2.0997	2.2300	1.1725	3.4625	1.1675
10Y	2.1600	0.50	2.1695	2.1979	2.1605	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.1975	0.50	2.2070	2.2356	2.1938	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2150	1.00	2.2190	2.2430	2.2027	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2125	1.00	2.2165	2.2399	2.2070	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.25	-0.25	5.45	7.13	8.25	12.50	-3.75	12.50	-6.00
9*12M	7.00	1.50	5.80	6.93	7.66	10.50	-2.50	10.50	-4.25
1*2Y	12.75	0.00	12.70	14.16	15.92	20.75	-5.25	20.75	-5.50
2*3Y	5.75	-1.25	7.00	7.89	8.49	11.00	-1.25	15.00	-1.75
2*4Y	10.50	-0.75	11.65	13.29	13.90	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	14.00	-0.75	15.20	16.81	17.58	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	4.75	0.50	4.65	5.40	5.42	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.25	0.50	8.20	8.93	9.09	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.55	3.53	3.67	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	2.75	-0.25	3.10	3.55	4.16	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	7.50	-0.25	8.45	9.24	10.24	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	4.75	0.00	5.35	5.69	6.08	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.78	3.33	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.50	4.95	4.51	4.22	5.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.50	4.70	4.20	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	1.828	1.00	1.823	1.833	1.748	1.885	1.252	2.720	1.237
1.5Y	1.958	2.10	1.946	1.982	1.901	2.037	1.240	2.820	1.232
2Y	2.056	1.60	2.046	2.069	1.992	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.082	0.70	2.082	2.114	2.050	2.206	1.202	3.050	1.200
4Y	2.210	0.30	2.223	2.262	2.209	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.270	0.30	2.282	2.308	2.254	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.398	-0.20	2.411	2.443	2.401	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.450	-0.50	2.465	2.500	2.470	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.439	-0.10	2.447	2.476	2.445	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	108.30	0.00	108.37	108.41	108.28
LKTb	122.43	0.06	122.57	122.68	122.37

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	-1.05	0.50	-1.70	-3.68	-2.49	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-5.80	-0.35	-6.05	-10.32	-8.44	2.40	-19.10	8.50	-19.10
2Y	-11.10	-0.10	-11.34	-13.14	-10.99	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-7.95	-0.45	-7.94	-9.77	-8.24	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-16.00	0.45	-17.33	-19.21	-18.72	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-18.50	0.45	-19.68	-20.28	-19.62	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-28.55	0.70	-29.46	-30.17	-30.15	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-29.00	1.00	-29.59	-30.16	-30.91	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-22.65	1.10	-23.03	-23.64	-23.76	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS			USD/KRW			1089.10 (-1.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-51.75	-3.50	1Y	1.3000	-2.00	1.6200	0.7650	1*2Y	8.50	3.50
-55.00	-1.75	1.5Y	1.3500	0.00	1.6600	0.9200	2*3Y	7.50	-0.50
-56.00	0.00	2Y	1.3850	1.50	1.6950	0.8250	2*5Y	16.00	0.00
-54.25	0.75	3Y	1.4600	1.00	1.7550	0.7700	3*4Y	4.50	0.00
-54.50	0.25	4Y	1.5050	1.00	1.8000	0.7250	3*5Y	8.50	0.50
-54.00	0.75	5Y	1.5450	1.50	1.8500	0.7000	4*5Y	4.00	0.50
-51.75	1.00	7Y	1.5950	1.50	1.8950	0.7050	5*7Y	5.00	0.00
-44.00	1.50	10Y	1.7200	2.00	2.0150	0.6750	5*10Y	17.50	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	1.8110	0.0327	1.7783	1.8231	1.8189	1.8305	0.6200	1.8305	0.2800
10Y	2.3531	0.0098	2.3433	2.4076	2.3923	2.6060	1.3700	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	-24.50	1.67	-26.17	-21.39	-22.81	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-9.69	1.48	-11.17	-4.74	-8.77	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	21.50	-1.00	22.50	23.75	24.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	39.40	-2.10	41.50	41.80	43.30	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	54.21	-2.29	56.50	58.45	57.34	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS				ODD Tenor					
06M									
09M									
01Y	79.25								
1.5Y	87.75 / 89.75 / 90								
02Y	93.25 / 93.5 / 93.75			SPRD	6*12m	10.5			
03Y	98 / 98.5				1*2y	12.5			
04Y					2*3y	6.5			
05Y	5.75 / 06 / 7.25 / 7.75				2*5y	14.25			
07Y									
10Y									
12Y									
15Y	20.5								
20Y									
CRS	3*4y 4.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	91 건	6	85	97	31	66	80	91	
금 액	43,501 억원	16,630	26,871	23,087	7,700	26,050	24,915	27,018	

장중동향

금일 채권은 미국 FOMC 금리인하에 따라 강세 출발 강세를 유지하는 듯 하다 되돌림. ECB와 다음주 예정된 국채발행계획등의 대기등으로 강세폭을 점점줄여 보합세 마감.

IRS는 오전부터 단기를 중심으로 비드가 줄어있었고, 특히 1년과 3년은 전일비 1.5bp, 1.5년은 1.75bp 상승하는등 상당히 비디 시. 5년, 10년은 오히려.

CRS는 1년을 제외하고 상승, 커브 소폭 스프 마감.