

IPS Daily Morning Brief

2017-12-21

종가 기준일 2017-12-20

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6900	-1.00	1.6955	1.6729	1.5801	1.7000	1.2900	2.6925	1.2875
9M	1.7475	-1.50	1.7530	1.7353	1.6628	1.7625	1.2600	2.7275	1.2500
1Y	1.8125	-1.75	1.8205	1.8004	1.7400	1.8300	1.2375	2.7675	1.2200
1.5Y	1.8975	-2.00	1.9050	1.8823	1.8339	1.9300	1.2050	2.8475	1.1900
2Y	1.9600	-1.00	1.9570	1.9369	1.9002	2.0175	1.1850	2.9225	1.1675
3Y	2.0225	-0.75	2.0150	2.0098	1.9838	2.1075	1.1725	3.0650	1.1550
4Y	2.0725	-0.25	2.0610	2.0613	2.0377	2.1600	1.1675	3.1875	1.1575
5Y	2.1025	0.25	2.0885	2.0946	2.0737	2.1900	1.1675	3.3050	1.1575
7Y	2.1350	0.75	2.1170	2.1284	2.1139	2.2300	1.1750	3.4625	1.1675
10Y	2.1875	1.50	2.1640	2.1836	2.1728	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2250	1.50	2.2015	2.2211	2.2064	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2425	1.50	2.2190	2.2310	2.2158	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2400	1.50	2.2165	2.2284	2.2192	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.75	-0.50	5.75	6.24	8.27	12.50	-3.50	12.50	-6.00
9*12M	6.50	-0.25	6.75	6.51	7.73	10.50	-2.50	10.50	-4.25
1*2Y	14.75	0.75	13.65	13.65	16.02	20.75	-5.25	20.75	-5.50
2*3Y	6.25	0.25	5.80	7.29	8.35	11.00	-1.25	15.00	-1.75
2*4Y	11.25	0.75	10.40	12.44	13.75	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	14.25	1.25	13.15	15.78	17.35	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.50	4.60	5.15	5.39	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.00	1.00	7.35	8.49	9.00	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.00	0.50	2.75	3.34	3.60	6.25	0.00	11.75	-0.25
5*7Y	3.25	0.50	2.85	3.37	4.02	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	8.50	1.25	7.55	8.90	9.90	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	5.25	0.75	4.70	5.53	5.89	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.75	3.36	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	5.50	0.00	5.50	4.74	4.30	5.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.00	5.25	4.48	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	1.850	-1.10	1.850	1.839	1.770	1.885	1.252	2.720	1.237
1.5Y	1.975	-0.90	1.975	1.976	1.922	2.037	1.240	2.820	1.232
2Y	2.050	-2.20	2.062	2.058	2.013	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.077	-1.50	2.082	2.098	2.067	2.206	1.202	3.050	1.200
4Y	2.226	0.00	2.214	2.241	2.225	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.292	0.50	2.275	2.290	2.272	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.417	1.20	2.398	2.423	2.414	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.462	1.80	2.444	2.478	2.479	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.447	3.50	2.428	2.451	2.451	2.572	1.430	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	108.09	0.05	108.00	108.12	107.98
LKTb	121.97	-0.22	121.90	122.11	121.87

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-3.75	-0.65	-2.93	-3.82	-3.00	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-7.75	-1.10	-6.96	-9.34	-8.76	2.40	-19.10	8.50	-19.10
2Y	-9.00	1.20	-10.46	-12.07	-11.25	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.45	0.75	-6.68	-8.81	-8.32	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-15.35	-0.25	-15.34	-18.01	-18.70	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-18.95	-0.25	-18.61	-19.58	-19.80	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-28.20	-0.45	-28.10	-29.45	-30.03	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-27.45	-0.30	-27.98	-29.43	-30.58	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-20.70	-2.00	-21.11	-22.25	-23.21	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1080.90 (-4.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-59.25	1.25	1Y	1.2200	-0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	13.50	1.00	
-59.75	2.00	1.5Y	1.3000	0.00	1.6600	1.0100	2*3Y	9.00	1.00	
-60.50	1.50	2Y	1.3550	0.50	1.6950	0.9350	2*5Y	19.00	1.50	
-57.75	2.25	3Y	1.4450	1.50	1.7550	0.8550	3*4Y	5.00	0.00	
-57.75	1.75	4Y	1.4950	1.50	1.8000	0.8400	3*5Y	10.00	0.50	
-55.75	1.75	5Y	1.5450	2.00	1.8500	0.8250	4*5Y	5.00	0.50	
-53.50	1.75	7Y	1.6000	2.50	1.8950	0.8050	5*7Y	5.50	0.50	
-45.75	1.00	10Y	1.7300	2.50	2.0150	0.7900	5*10Y	18.50	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	1.8526	-0.0040	1.8566	1.8277	1.8399	1.8566	0.6460	1.8566	0.2800
10Y	2.5009	0.0327	2.4682	2.3926	2.3576	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	-19.74	1.8	-21.54	-24.73	-21.51	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	3.89	1.47	2.42	-4.04	-7.24	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	22.75	2.50	20.25	19.50	19.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	41.20	4.00	37.20	35.80	37.50	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	64.83	3.67	61.16	56.49	51.77	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor	8Y 15.25			
06M	69.75								
09M	75.25								
01Y									
1.5Y	90.5								
02Y	95.75 / 96.25								
03Y					SPRD	6*9M 5.75			
04Y	7.25 / 08					2*4Y 11.25			
05Y	10.25 / 11								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	69 건		13	56	50	115	91	85	97
금 액	19,560 억원		2,220	17,340	12,060	34,754	43,501	26,871	23,087

장중동향

국고채 금리, 단기물 금리 하락 & 장기물 금리 상승. 그동안의 플레트닝 흐름 되돌림.

장 마감후 발표되는 내년 국고채 발행 계획에 주목

IRS, 4Y이하 구간 금리 하락 & 5Y이상 구간 금리 상승 마감. 커브 스티프닝.

단기물 위주의 수요가 많았으며 주로 기본되는 양상.

CRS, 대부분의 구간에서 금리 상승. 별다른 거래없이 한산했던 장.