

IPS Daily Morning Brief

2017-12-28

종가 기준일 2017-12-27

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7000	0.25	1.6955	1.6895	1.5951	1.7000	1.2925	2.6925	1.2875
9M	1.7600	0.50	1.7525	1.7443	1.6773	1.7625	1.2600	2.7275	1.2500
1Y	1.8350	0.50	1.8235	1.8069	1.7547	1.8350	1.2375	2.7675	1.2200
1.5Y	1.9375	1.25	1.9170	1.8904	1.8493	1.9375	1.2050	2.8475	1.1900
2Y	2.0150	1.75	1.9870	1.9468	1.9164	2.0175	1.1850	2.9225	1.1675
3Y	2.0875	2.25	2.0530	2.0163	1.9985	2.1075	1.1725	3.0650	1.1550
4Y	2.1225	1.75	2.0960	2.0651	2.0518	2.1600	1.1675	3.1875	1.1575
5Y	2.1550	1.75	2.1280	2.0979	2.0872	2.1900	1.1675	3.3050	1.1575
7Y	2.1875	1.75	2.1590	2.1308	2.1262	2.2300	1.1750	3.4625	1.1675
10Y	2.2325	1.50	2.2085	2.1843	2.1831	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2675	1.50	2.2450	2.2215	2.2170	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2800	1.25	2.2610	2.2335	2.2266	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2800	1.25	2.2595	2.2313	2.2294	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	6.00	0.25	5.70	5.48	8.22	12.50	-3.50	12.50	-6.00
9*12M	7.50	0.00	7.10	6.26	7.74	10.50	-2.50	10.50	-4.25
1*2Y	18.00	1.25	16.35	13.99	16.18	20.75	-5.25	20.75	-5.50
2*3Y	7.25	0.50	6.60	6.95	8.21	11.00	-1.25	15.00	-1.75
2*4Y	10.75	0.00	10.90	11.84	13.54	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	14.00	0.00	14.10	15.11	17.08	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	3.50	-0.50	4.30	4.89	5.33	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	6.75	-0.50	7.50	8.16	8.86	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.20	3.27	3.53	6.25	0.00	11.75	-0.25
5*7Y	3.25	0.00	3.10	3.29	3.90	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	7.75	-0.25	8.05	8.64	9.59	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	4.50	-0.25	4.95	5.35	5.69	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.00	3.65	3.73	3.39	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	-0.25	5.25	4.93	4.35	5.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.75	-0.25	5.10	4.70	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	1.872	0.10	1.862	1.842	1.790	1.885	1.252	2.720	1.237
1.5Y	2.031	1.60	2.002	1.973	1.940	2.037	1.240	2.820	1.232
2Y	2.120	1.30	2.089	2.058	2.032	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.152	2.20	2.114	2.093	2.083	2.206	1.202	3.050	1.200
4Y	2.315	3.80	2.265	2.237	2.240	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.367	3.20	2.325	2.290	2.288	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.475	2.40	2.444	2.419	2.426	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.502	1.20	2.483	2.471	2.486	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.460	1.50	2.447	2.437	2.456	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	107.83	-0.11	107.94	107.97	107.79
LKTb	121.50	-0.18	121.74	121.84	121.41

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	-3.70	0.40	-3.81	-3.47	-3.50	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-9.35	-0.35	-8.46	-8.21	-9.12	2.40	-19.10	8.50	-19.10
2Y	-10.50	0.45	-10.18	-11.14	-11.55	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-6.45	0.05	-6.08	-7.71	-8.41	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-19.25	-2.05	-16.90	-17.16	-18.83	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-21.20	-1.45	-19.68	-19.25	-20.13	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-28.75	-0.65	-28.46	-28.87	-29.99	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-26.95	0.30	-27.43	-28.72	-30.27	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-18.00	-0.25	-18.71	-20.61	-22.69	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1074.10 (-2.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-51.50	-0.50	1Y	1.3200	0.00	1.6200	0.7650	1*2Y	15.00	1.00	
-54.25	-0.75	1.5Y	1.3950	0.50	1.6600	1.0350	2*3Y	10.00	1.00	
-54.50	-0.75	2Y	1.4700	1.00	1.6950	0.9650	2*5Y	20.00	1.50	
-51.75	-0.25	3Y	1.5700	2.00	1.7550	0.8550	3*4Y	5.50	0.50	
-49.75	0.75	4Y	1.6250	2.50	1.8000	0.8400	3*5Y	10.00	0.50	
-48.50	0.75	5Y	1.6700	2.50	1.8500	0.8250	4*5Y	4.50	0.00	
-46.25	0.75	7Y	1.7250	2.50	1.8950	0.8050	5*7Y	5.50	0.00	
-37.75	1.00	10Y	1.8550	2.50	2.0150	0.7900	5*10Y	18.50	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	1.8912	-0.0121	1.9033	1.8948	1.8981	1.9033	0.6460	1.9033	0.2800
10Y	2.4108	-0.0668	2.4776	2.4839	2.4846	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	-22.88	-2.51	-20.37	-20.52	-16.89	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-9.12	-7.88	-1.24	-0.61	1.46	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	21.75	-0.25	22.00	21.50	22.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	38.20	-0.10	38.30	39.00	40.30	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	51.96	-5.47	57.43	58.91	58.65	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	1.75				SPRD	3*5Y 6.75			
03Y									
04Y	11								
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	58 건	15	43	59	43	69	56	50	
금 액	16,665 억원	7,942	8,723	16,160	13,790	19,560	17,340	12,060	

장종동향
 국고채 금리, 상승 마감. 외인 원화채 대량 매도.

IRS, 금리 상승.
 외국인의 대규모 현물 매도에 IRS도 연동되는 모습. 특히 3년이 상대적으로 비디쉬함.

CRS, 1년을 제외한 구간에서 상승. 커브 스톱.