

IPS Daily Morning Brief

2017-11-24

종가 기준일 2017-11-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6075	-1.25	1.6075	1.5800	1.5029	1.6200	1.2875	2.7200	1.2875
9M	1.7050	-1.50	1.7095	1.6883	1.5811	1.7250	1.2500	2.7300	1.2500
1Y	1.7900	-1.50	1.7965	1.7793	1.6532	1.8200	1.2200	2.7675	1.2200
1.5Y	1.8750	-2.00	1.8875	1.8848	1.7406	1.9300	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	1.9425	-2.25	1.9585	1.9645	1.8053	2.0175	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0275	-2.50	2.0460	2.0551	1.8903	2.1075	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.0825	-2.75	2.1035	2.1130	1.9445	2.1600	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1175	-3.00	2.1385	2.1470	1.9823	2.1900	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.1525	-3.00	2.1755	2.1866	2.0288	2.2300	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2100	-2.75	2.2310	2.2386	2.0948	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2475	-2.75	2.2695	2.2708	2.1268	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2525	-2.75	2.2745	2.2766	2.1359	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2475	-2.75	2.2695	2.2783	2.1438	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	9.75	-0.25	10.20	10.83	7.82	12.50	-4.50	12.50	-6.00
9*12M	8.50	0.00	8.70	9.10	7.21	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	15.25	-0.75	16.20	18.53	15.21	20.75	-5.50	20.75	-5.50
2*3Y	8.50	-0.25	8.75	9.06	8.50	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.00	-0.50	14.50	14.85	13.93	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.50	-0.75	18.00	18.25	17.70	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	-0.25	5.75	5.79	5.42	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.00	-0.50	9.25	9.19	9.20	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	-0.25	3.50	3.40	3.78	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	3.50	0.00	3.70	3.96	4.65	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	9.25	0.25	9.25	9.16	11.25	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	5.75	0.25	5.55	5.20	6.61	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.85	3.21	3.20	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.35	3.79	4.10	5.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	0.00	3.85	3.96	4.89	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.831	0.00	1.826	1.829	1.659	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	2.011	-1.00	2.012	2.011	1.808	2.037	1.232	2.820	1.232
2Y	2.095	-2.00	2.114	2.115	1.903	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.140	-2.50	2.158	2.157	1.965	2.206	1.200	3.050	1.200
4Y	2.292	-3.00	2.315	2.326	2.122	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.327	-3.30	2.357	2.372	2.173	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.467	-2.40	2.491	2.501	2.333	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.522	-1.80	2.544	2.551	2.415	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.532	-1.00	2.548	2.524	2.408	2.572	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.49	1.00
CALL	1.23	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.05	0.11	107.99	108.06	107.96
LKTb	121.68	0.21	121.60	121.77	121.51

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	-4.10	-1.50	-2.97	-4.98	-0.60	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-13.60	-1.00	-12.43	-12.66	-6.70	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-15.25	-0.25	-15.59	-15.06	-9.74	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-11.25	0.00	-11.18	-10.16	-7.45	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-20.95	0.25	-21.13	-21.31	-17.79	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-20.95	0.30	-21.89	-22.47	-19.07	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.45	-0.60	-31.57	-31.46	-30.45	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.20	-0.95	-31.34	-31.22	-32.04	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-28.45	-1.75	-27.81	-24.57	-26.43	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1085.40 (-3.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-23.00	-1.50	1Y	1.5600	-3.00	1.6200	0.7650	1*2Y	5.00	1.00	
-28.50	-0.50	1.5Y	1.5900	-2.50	1.6600	0.8950	2*3Y	5.00	0.00	
-33.25	0.25	2Y	1.6100	-2.00	1.6950	0.7950	2*5Y	12.00	-0.50	
-36.75	0.50	3Y	1.6600	-2.00	1.7550	0.7350	3*4Y	3.50	-0.50	
-38.75	0.25	4Y	1.6950	-2.50	1.8000	0.6900	3*5Y	7.00	-0.50	
-38.75	0.50	5Y	1.7300	-2.50	1.8500	0.6600	4*5Y	3.50	0.00	
-38.25	0.50	7Y	1.7700	-2.50	1.8950	0.6550	5*7Y	4.00	0.00	
-32.50	0.25	10Y	1.8850	-2.50	2.0150	0.6300	5*10Y	15.50	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	1.7308	0.0000	1.7308	1.7797	1.7505	1.7797	0.5600	1.7797	0.2800
10Y	2.3187	0.0000	2.3187	2.3568	2.3710	2.6060	1.3600	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	-36.42	2	-38.42	-34.03	-35.95	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-20.33	1.80	-22.13	-18.82	-17.40	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	26.75	-0.50	27.25	28.50	27.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	42.70	0.20	42.50	42.50	43.50	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	58.79	0.00	58.79	57.71	62.05	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	72								
01Y	78								
1.5Y	88.5 / 89.25								
02Y	94.25 / 95								
03Y	2.5	SPRD	1*2y		10.5 / 10.75				
04Y			3*7y		12.5				
05Y									
07Y	18								
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y 62								
	3y 66 / 66.5								
	4y 71								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	59 건	-27	86	94	100	78	127		
금 액	20,195 억원	-3,905	24,100	33,455	32,204	26,208	39,585	45,789	

장중동향

채권은 미국금리하락을 반영, 강보합 출발해 장중 내내 강세를 보이고 금리 하락 마감.

IRS는 국채선물이 강세를 보이면서 꾸준히 오퍼가 나와 전구간 하락.

CRS는 그간의 금리 상승되돌림으로 하락 마감.