

IPS Daily Morning Brief

2017-11-27

종가 기준일 2017-11-24

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6200	1.25	1.6095	1.5840	1.5061	1.6200	1.2875	2.7200	1.2875
9M	1.7175	1.25	1.7095	1.6923	1.5853	1.7250	1.2500	2.7300	1.2500
1Y	1.8050	1.50	1.7955	1.7825	1.6581	1.8200	1.2200	2.7675	1.2200
1.5Y	1.8975	2.25	1.8860	1.8869	1.7459	1.9300	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	1.9625	2.00	1.9550	1.9659	1.8109	2.0175	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0450	1.75	2.0420	2.0554	1.8960	2.1075	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.1000	1.75	2.0985	2.1125	1.9502	2.1600	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1350	1.75	2.1345	2.1466	1.9878	2.1900	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.1700	1.75	2.1710	2.1858	2.0338	2.2300	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2275	1.75	2.2270	2.2385	2.0995	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2650	1.75	2.2655	2.2711	2.1316	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2700	1.75	2.2705	2.2767	2.1406	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2675	2.00	2.2660	2.2778	2.1481	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	9.75	0.00	10.00	10.83	7.91	12.50	-4.50	12.50	-6.00
9*12M	8.75	0.25	8.60	9.03	7.28	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	15.75	0.50	15.95	18.34	15.28	20.75	-5.50	20.75	-5.50
2*3Y	8.25	-0.25	8.70	8.95	8.51	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.75	-0.25	14.35	14.66	13.93	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.25	-0.25	17.95	18.08	17.69	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.00	5.65	5.71	5.42	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.00	0.00	9.25	9.12	9.18	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.60	3.41	3.76	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	3.50	0.00	3.65	3.91	4.60	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	9.25	0.00	9.25	9.19	11.18	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	5.75	0.00	5.60	5.28	6.58	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.85	3.26	3.21	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.35	3.82	4.10	5.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	0.25	3.90	3.93	4.85	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.853	2.20	1.832	1.829	1.666	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	2.031	2.00	2.015	2.013	1.815	2.037	1.232	2.820	1.232
2Y	2.112	1.70	2.110	2.115	1.910	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.167	2.70	2.157	2.157	1.972	2.206	1.200	3.050	1.200
4Y	2.314	2.20	2.312	2.324	2.130	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.350	2.30	2.351	2.369	2.179	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.487	2.00	2.486	2.501	2.339	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.540	1.80	2.538	2.551	2.420	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.540	0.80	2.544	2.529	2.411	2.572	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.50	1.00
CALL	1.23	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.95	-0.10	108.02	108.06	107.95
LKTb	121.48	-0.20	121.57	121.80	121.48

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	-4.80	-0.70	-3.61	-4.66	-0.77	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-13.35	0.25	-12.92	-12.57	-6.91	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-14.95	0.30	-15.54	-14.89	-9.90	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-12.20	-0.95	-11.48	-10.17	-7.58	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-21.40	-0.45	-21.31	-21.18	-17.98	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-21.50	-0.55	-21.67	-22.23	-19.16	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.70	-0.25	-31.46	-31.48	-30.50	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.25	-0.05	-31.14	-31.26	-32.00	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-27.25	1.20	-27.76	-25.09	-26.33	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS			USD/KRW			1085.40 (0.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-25.50	-2.50	1Y	1.5500	-1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	5.50	0.50
-31.25	-2.75	1.5Y	1.5850	-0.50	1.6600	0.8950	2*3Y	5.50	0.50
-35.75	-2.50	2Y	1.6050	-0.50	1.6950	0.7950	2*5Y	12.50	0.50
-38.50	-1.75	3Y	1.6600	0.00	1.7550	0.7350	3*4Y	3.50	0.00
-40.50	-1.75	4Y	1.6950	0.00	1.8000	0.6900	3*5Y	7.00	0.00
-40.50	-1.75	5Y	1.7300	0.00	1.8500	0.6600	4*5Y	3.50	0.00
-40.00	-1.75	7Y	1.7700	0.00	1.8950	0.6550	5*7Y	4.00	0.00
-34.25	-1.75	10Y	1.8850	0.00	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	1.7443	0.0135	1.7308	1.7308	1.7797	1.7797	0.5600	1.7797	0.2800
10Y	2.3436	0.0249	2.3187	2.3187	2.3568	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	-36.77	-0.35	-36.42	-38.42	-34.03	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-19.64	0.69	-20.33	-22.13	-18.82	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	26.50	-0.25	26.75	27.25	28.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	42.80	0.10	42.70	42.50	42.50	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	59.93	1.14	58.79	58.79	57.71	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	60.75								
09M	70.5								
01Y	79								
1.5Y	87.5								
02Y	94.25 94.5 96.25				SPRD	1*2y/15.25			
03Y						9*12m/8.5			
04Y						6*9m/9.75			
05Y	12.75 13.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	73 건	14	59	86	94	100	78	127	
금 액	32,220 억원	12,025	20,195	24,100	33,455	32,204	26,208	39,585	

장중동향

IRS는 전반적으로 조용한 모습을 보이며 상승 마감. 보험권에 머물던 국채선물이 오후 들어서 밀렸는데, IRS는 이를 일부 반영하는 데 그친 듯함. 미국 장도 휴장이어서 특별한 재료는 없었음.

CRS 금리는 1-2년을 제외하고 움직이지 않았음. 크로스 또한 특별한 거래 소식은 없었음.