

IPS Daily Morning Brief

2017-11-28

종가 기준일 2017-11-27

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6150	-0.50	1.6125	1.5865	1.5092	1.6200	1.2875	2.7200	1.2875
9M	1.7125	-0.50	1.7115	1.6948	1.5893	1.7250	1.2500	2.7300	1.2500
1Y	1.8000	-0.50	1.7975	1.7845	1.6628	1.8200	1.2200	2.7675	1.2200
1.5Y	1.8875	-1.00	1.8870	1.8878	1.7509	1.9300	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	1.9475	-1.50	1.9535	1.9663	1.8160	2.0175	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0325	-1.25	2.0400	2.0551	1.9013	2.1075	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.0875	-1.25	2.0960	2.1116	1.9553	2.1600	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1250	-1.00	2.1330	2.1458	1.9928	2.1900	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.1600	-1.00	2.1690	2.1845	2.0383	2.2300	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2175	-1.00	2.2255	2.2380	2.1037	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2550	-1.00	2.2635	2.2713	2.1359	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2600	-1.00	2.2685	2.2768	2.1447	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2575	-1.00	2.2645	2.2773	2.1519	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	9.75	0.00	9.90	10.83	8.00	12.50	-4.50	12.50	-6.00
9*12M	8.75	0.00	8.60	8.98	7.35	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	14.75	-1.00	15.60	18.18	15.33	20.75	-5.50	20.75	-5.50
2*3Y	8.50	0.25	8.65	8.89	8.52	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.00	0.25	14.25	14.54	13.93	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.75	0.50	17.95	17.95	17.68	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.00	5.60	5.65	5.41	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.25	0.25	9.30	9.06	9.15	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.75	0.25	3.70	3.41	3.75	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	3.50	0.00	3.60	3.88	4.55	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	9.25	0.00	9.25	9.23	11.09	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	5.75	0.00	5.65	5.35	6.54	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.80	3.33	3.22	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.30	3.88	4.10	5.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	0.00	3.90	3.93	4.82	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.863	1.00	1.840	1.829	1.673	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	2.033	0.20	2.021	2.014	1.822	2.037	1.232	2.820	1.232
2Y	2.095	-1.70	2.107	2.114	1.916	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.145	-2.20	2.155	2.157	1.978	2.206	1.200	3.050	1.200
4Y	2.302	-1.20	2.310	2.323	2.137	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.337	-1.30	2.347	2.366	2.185	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.474	-1.30	2.482	2.500	2.344	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.530	-1.00	2.535	2.552	2.423	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.540	0.00	2.540	2.532	2.414	2.572	1.430	3.943	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	108.04	0.09	107.96	108.04	107.95
LKTb	121.58	0.10	121.48	121.66	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	-6.30	-1.50	-4.25	-4.44	-0.98	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-14.55	-1.20	-13.40	-12.58	-7.14	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-14.75	0.20	-15.39	-14.78	-10.03	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-11.25	0.95	-11.54	-10.23	-7.67	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-21.45	-0.05	-21.40	-21.10	-18.14	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-21.20	0.30	-21.42	-22.06	-19.23	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.40	0.30	-31.32	-31.54	-30.54	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.25	0.00	-30.99	-31.36	-31.97	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-28.25	-1.00	-27.57	-25.51	-26.21	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS				USD/KRW		1088.06 (+2.66)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-26.00	-0.50	1Y	1.5400	-1.00	1.6200	0.7650	1*2Y	5.50	0.00
-32.25	-1.00	1.5Y	1.5650	-2.00	1.6600	0.8950	2*3Y	6.50	1.00
-35.25	0.50	2Y	1.5950	-1.00	1.6950	0.7950	2*5Y	13.50	1.00
-37.25	1.25	3Y	1.6600	0.00	1.7550	0.7350	3*4Y	3.00	-0.50
-39.75	0.75	4Y	1.6900	-0.50	1.8000	0.6900	3*5Y	7.00	0.00
-39.50	1.00	5Y	1.7300	0.00	1.8500	0.6600	4*5Y	4.00	0.50
-39.00	1.00	7Y	1.7700	0.00	1.8950	0.6550	5*7Y	4.00	0.00
-33.25	1.00	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	1.7363	-0.0080	1.7443	1.7308	1.7308	1.7797	0.5600	1.7797	0.2800
10Y	2.3303	-0.0133	2.3436	2.3187	2.3187	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	-35.87	0.9	-36.77	-36.42	-38.42	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-19.97	-0.33	-19.64	-20.33	-22.13	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	27.00	0.50	26.50	26.75	27.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	43.50	0.70	42.80	42.70	42.50	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	59.40	-0.53	59.93	58.79	58.79	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	80								
1.5Y									
02Y	95.5	SPRD	4*15y 17.25						
03Y	3.75 / 04								
04Y	9.75								
05Y	13.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	70 건	-3	73	59	86	94	100	78	
금 액	23,867 억원	-8,353	32,220	20,195	24,100	33,455	32,204	26,208	

장중동향

채권은 금통위를 앞두고 제한된 흐름속에 강보합세를 보였고, 상대적으로 초장기는 약세를 보이며 금리 혼조.

IRS는 2~5년 구간의 오퍼가 꾸준히 나오며 거래가 집중. 커브도 단기부터 2년까지는 소폭플랫, 그 뒤로는 소폭스텝 마감.

CRS는 특정 테너를 제외하고는 레벨 변동이 없음.