

IPS Daily Morning Brief

2017-12-08

종가 기준일 2017-12-07

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6900	0.25	1.6925	1.6311	1.5425	1.7000	1.2875	2.6925	1.2875
9M	1.7450	0.25	1.7405	1.7164	1.6244	1.7500	1.2500	2.7275	1.2500
1Y	1.8000	0.25	1.7955	1.7941	1.7001	1.8200	1.2200	2.7675	1.2200
1.5Y	1.8800	0.50	1.8720	1.8844	1.7911	1.9300	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	1.9325	0.00	1.9265	1.9523	1.8573	2.0175	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0075	0.75	2.0025	2.0356	1.9425	2.1075	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.0600	0.75	2.0580	2.0915	1.9970	2.1600	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.0950	0.75	2.0935	2.1256	2.0338	2.1900	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.1325	1.00	2.1320	2.1628	2.0773	2.2300	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.1925	1.00	2.1935	2.2201	2.1401	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2300	1.00	2.2310	2.2573	2.1730	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2375	1.00	2.2385	2.2633	2.1816	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2350	1.00	2.2360	2.2600	2.1869	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.50	0.00	4.80	8.53	8.19	12.50	-4.50	12.50	-6.00
9*12M	5.50	0.00	5.50	7.78	7.58	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	13.25	-0.25	13.10	15.81	15.71	20.75	-5.25	20.75	-5.50
2*3Y	7.50	0.75	7.60	8.34	8.53	11.00	-1.25	15.00	-1.75
2*4Y	12.75	0.75	13.15	13.93	13.98	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.25	0.75	16.70	17.34	17.65	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	0.00	5.55	5.59	5.45	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.75	0.00	9.10	9.00	9.13	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.55	3.41	3.68	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	3.75	0.25	3.85	3.71	4.35	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	9.75	0.25	10.00	9.45	10.63	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	6.00	0.00	6.15	5.74	6.28	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.71	3.29	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.00	4.50	4.32	4.15	4.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.25	0.00	4.25	3.99	4.68	7.50	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.839	0.00	1.831	1.831	1.722	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	1.963	-0.30	1.959	2.000	1.873	2.037	1.232	2.820	1.232
2Y	2.055	0.40	2.040	2.093	1.964	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.095	0.50	2.092	2.138	2.023	2.206	1.200	3.050	1.200
4Y	2.236	0.40	2.236	2.291	2.184	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.287	1.00	2.280	2.333	2.228	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.424	1.20	2.422	2.471	2.381	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.485	1.50	2.485	2.528	2.453	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.440	1.80	2.435	2.501	2.432	2.572	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.66	0.00
CALL	1.48	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.23	-0.02	108.23	108.30	108.21
LKTB	122.11	-0.15	122.24	122.34	122.11

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	-3.90	0.25	-3.59	-3.68	-2.14	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-8.30	0.80	-8.68	-11.58	-8.18	2.40	-19.10	8.50	-19.10
2Y	-12.25	-0.40	-11.35	-14.09	-10.65	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-8.75	0.25	-8.93	-10.27	-8.04	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-17.60	0.35	-17.80	-19.90	-18.67	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-19.20	-0.25	-18.67	-20.77	-19.46	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.15	-0.20	-28.98	-30.81	-30.35	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-29.25	-0.50	-29.19	-30.83	-31.34	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-20.50	-0.80	-19.86	-24.14	-24.52	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1093.50 (-0.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-34.00	-3.75	1Y	1.4600	-3.50	1.6200	0.7650	1*2Y	4.50	2.50	
-40.50	-3.00	1.5Y	1.4750	-2.50	1.6600	0.8950	2*3Y	6.50	0.50	
-42.75	-1.00	2Y	1.5050	-1.00	1.6950	0.7950	2*5Y	14.00	1.00	
-43.75	-1.25	3Y	1.5700	-0.50	1.7550	0.7350	3*4Y	4.00	0.50	
-45.00	-0.75	4Y	1.6100	0.00	1.8000	0.6900	3*5Y	7.50	0.50	
-45.00	-0.75	5Y	1.6450	0.00	1.8500	0.6600	4*5Y	3.50	0.00	
-44.75	-1.00	7Y	1.6850	0.00	1.8950	0.6550	5*7Y	4.00	0.00	
-41.75	-1.00	10Y	1.7750	0.00	2.0150	0.6300	5*10Y	13.00	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	1.7984	0.0001	1.7983	1.8305	1.8103	1.8305	0.5600	1.8305	0.2800
10Y	2.3643	0.0249	2.3394	2.3527	2.3723	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	-25.66	-0.39	-25.27	-22.65	-21.17	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-12.07	0.99	-13.06	-15.23	-10.97	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	26.00	1.00	25.00	27.00	27.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	43.00	1.10	41.90	44.80	46.00	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	56.59	2.48	54.11	52.22	56.20	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS		ODD Tenor								
06M										
09M	74.75									
01Y	80									
1.5Y	87.5									
02Y	92.75									
03Y	0	SPRD	1*3y	20.25						
04Y	5		3*4y	5.25						
04Y	5		4*7y	7.25						
05Y	8.5		6*12y	11.25						
07Y										
10Y	18.25									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	1y 47 / 2y 50 / 5y 64.5									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			80 건	-11	91	81	55	143	160	123
금 액			24,915 억원	-2,103	27,018	12,326	21,695	45,150	64,878	46,248

장중동향

채권은 다음주 FOMC를 앞두고 경계심이 커지는 모습. 특별한 재료없이 연말장세를 반영 금리 소폭 상승.

IRS는 스프레드보다 아웃라잇 거래가 주를 이뤘고, 장중 강세를 보이다가 되돌리며 마감. 커브는 소폭 스티프닝.

CRS 단기구간에서 소폭 하락 마감.