IPS Daily Morning Brief

2017-12-06

종가 기준일 2017-12-05

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7000	0.50	1.6750	1.6188	1.5336	1.7000	1.2875	2.6925	1.2875
9M	1.7500	1.50	1.7250	1.7098	1.6150	1.7500	1.2500	2.7275	1.2500
1Y	1.8050	1.50	1.7840	1.7909	1.6904	1.8200	1.2200	2.7675	1.2200
1.5Y	1.8825	2.00	1.8625	1.8843	1.7805	1.9300	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	1.9400	2.50	1.9180	1.9551	1.8462	2.0175	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0175	2.25	1.9975	2.0404	1.9316	2.1075	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.0725	2.00	2.0560	2.0964	1.9860	2.1600	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1075	2.00	2.0910	2.1300	2.0229	2.1900	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.1475	2.00	2.1295	2.1671	2.0668	2.2300	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2100	2.00	2.1895	2.2230	2.1303	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2475	2.00	2.2270	2.2595	2.1630	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2550	2.00	2.2335	2.2654	2.1716	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2525	2.00	2.2310	2.2626	2.1773	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	5.00	1.00	5.00	9.10	8.14	12.50	-4.50	12.50	-6.00
9*12M	5.50	0.00	5.90	8.11	7.54	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	13.50	1.00	13.40	16.43	15.58	20.75	-5.25	20.75	-5.50
2*3Y	7.75	-0.25	7.95	8.53	8.54	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.25	-0.50	13.80	14.13	13.98	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.75	-0.50	17.30	17.49	17.67	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	-0.25	5.85	5.60	5.45	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.00	-0.25	9.35	8.96	9.13	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.50	3.36	3.68	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.00	3.85	3.71	4.39	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	10.25	0.00	9.85	9.30	10.74	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	6.25	0.00	6.00	5.59	6.35	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.65	3.27	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.00	4.40	4.24	4.13	4.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.25	0.00	4.15	3.96	4.70	7.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.837	1.60	1.832	1.828	1.710	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	1.969	2.10	1.969	2.004	1.861	2.037	1.232	2.820	1.232
2Y	2.057	3.50	2.036	2.098	1.951	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.115	3.30	2.090	2.144	2.011	2.206	1.200	3.050	1.200
4Y	2.260	3.30	2.238	2.298	2.173	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.300	3.30	2.280	2.340	2.217	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.441	2.50	2.421	2.478	2.371	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.505	2.30	2.485	2.534	2.446	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.448	1.90	2.433	2.508	2.427	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	108.17	-0.10	108.29	108.30	108.17
LKTB	121.89	-0.22	122.17	122.23	121.87

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-3.20	-0.10	-4.80	-3.67	-1.94	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-8.65	-0.10	-10.61	-11.97	-8.02	2.40	-19.10	8.50	-19.10
2Y	-11.70	-1.00	-11.78	-14.30	-10.50	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-9.75	-1.05	-9.27	-10.33	-7.95	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-18.75	-1.30	-18.22	-20.20	-18.65	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-19.25	-1.30	-18.88	-21.01	-19.42	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.35	-0.50	-29.17	-31.05	-30.44	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-29.50	-0.30	-29.57	-31.13	-31.53	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-19.55	0.10	-20.20	-24.57	-24.95	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-30.50	-1.00
-37.75	-2.00
-42.00	-2.50
-43.75	-2.25
-45.75	-2.00
-45.75	-2.00
-45.75	-2.00
-43.00	-2.00

CRS

USD/KRW 1085.80 (-2.90)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.5000	0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	2.00	-0.50
1.5Y	1.5050	0.00	1.6600	0.8950	2*3Y	6.00	0.00
2Y	1.5200	0.00	1.6950	0.7950	2*5Y	13.00	0.00
3Y	1.5800	0.00	1.7550	0.7350	3*4Y	3.50	0.00
4Y	1.6150	0.00	1.8000	0.6900	3*5Y	7.00	0.00
5Y	1.6500	0.00	1.8500	0.6600	4*5Y	3.50	0.00
7Y	1.6900	0.00	1.8950	0.6550	5*7Y	4.00	0.00
10Y	1.7800	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	1.8305	0.0202	1.8103	1.7620	1.7820	1.8305	0.5600	1.8305	0.2800
10Y	2.3527	-0.0196	2.3723	2.3624	2.4105	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	-22.65	-1.48	-21.17	-25.30	-24.30	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-15.23	-4.26	-10.97	-12.26	-6.65	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	27.50	28.00	27.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	44.80	-1.20	46.00	47.00	45.20	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	52.22	-3.98	56.20	60.04	62.85	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	
06M	69.25		
09M	73.25 / 74.5 / 75		
01Y	80		
1.5Y			
02Y	92 / 92.5	SPRD	6*9m 04
03Y	0		6*12m 9.5
04Y			1*2y 12.75
05Y	8.5		2*3y 7.5
07Y	12.75		
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2y 51.5 / 52		

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	81 건	26	55	143	160	123	89	70
금 액	12,326 억원	-9,369	21,695	45,150	64,878	46,248	34,480	23,867

장중동향

채권은 강보합으로 시작해서 오전내내 재료도 변동도 없이 거래없이 한산. 오후들어 국선이 약세로 전환하면서 금리상승 커브스팁 마감.

IRS는 거래없이 조용한 가운데 단기쪽으로 간간히 거래되었고, 스프레드로 엮여서 거래. 채권에 연동해서 레벨 상승한채 마감.

CRS도 1년, 2년 구간에만 호가가 형성되고 거래가 되는듯 했고 거의 변화없이 마감.