

IPS Daily Morning Brief

2017-10-30

종가 기준일 2017-10-27

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.5400	-0.50	1.5320	1.4974	1.4555	1.5550	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.6375	-0.50	1.6315	1.5779	1.5146	1.6800	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.7400	-0.75	1.7285	1.6559	1.5723	1.7800	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.8550	-1.25	1.8435	1.7518	1.6480	1.8850	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.9350	-1.50	1.9200	1.8178	1.7029	1.9575	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	2.0400	-2.00	2.0160	1.9055	1.7857	2.0600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.1100	-2.00	2.0795	1.9590	1.8392	2.1300	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1425	-2.00	2.1130	1.9988	1.8797	2.1625	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.1875	-2.25	2.1535	2.0450	1.9328	2.2100	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2300	-2.50	2.2020	2.1115	2.0094	2.2550	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2575	-2.50	2.2295	2.1428	2.0410	2.2825	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2675	-2.75	2.2405	2.1548	2.0525	2.2950	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2775	-3.00	2.2525	2.1655	2.0669	2.3075	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	9.75	0.00	9.95	8.05	5.91	12.50	-4.75	12.50	-6.00
9*12M	10.25	-0.25	9.70	7.80	5.78	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	19.50	-0.75	19.15	16.19	13.05	20.25	-5.50	20.25	-5.50
2*3Y	10.50	-0.50	9.60	8.78	8.28	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	17.50	-0.50	15.95	14.13	13.63	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	20.75	-0.50	19.30	18.10	17.68	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	7.00	0.00	6.35	5.35	5.35	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.00	9.70	9.33	9.40	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.35	3.98	4.05	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.50	-0.25	4.05	4.63	5.31	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	8.75	-0.50	8.90	11.28	12.97	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	4.25	-0.25	4.85	6.65	7.66	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	3.13	3.15	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	-0.25	3.85	4.33	4.31	6.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.75	-0.50	5.05	5.40	5.75	10.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.852	2.10	1.801	1.670	1.552	1.852	1.237	2.750	1.237
1.5Y	2.006	1.40	1.944	1.806	1.688	2.006	1.232	2.890	1.232
2Y	2.118	-0.20	2.046	1.895	1.773	2.120	1.225	2.990	1.225
3Y	2.160	-2.70	2.110	1.973	1.848	2.187	1.200	3.120	1.200
4Y	2.350	-1.00	2.286	2.134	1.988	2.360	1.232	3.340	1.232
5Y	2.405	-1.50	2.347	2.181	2.054	2.420	1.217	3.430	1.217
7Y	2.502	-1.60	2.457	2.339	2.229	2.518	1.270	3.590	1.270
10Y	2.535	-1.50	2.499	2.421	2.334	2.550	1.355	3.750	1.355
20Y	2.445	-1.00	2.425	2.390	2.358	2.455	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.40	0.02
CALL	1.22	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.80	0.08	107.72	107.83	107.44
LKTb	121.30	0.19	121.00	121.33	120.60

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-11.20	-2.85	-7.27	-1.36	1.99	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-15.10	-2.65	-10.09	-5.42	-4.01	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-18.30	-1.30	-12.62	-7.74	-7.04	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-12.00	0.70	-9.36	-6.71	-6.28	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-24.00	-1.00	-20.63	-17.51	-14.93	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-26.25	-0.50	-23.38	-18.21	-17.43	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.45	-0.65	-30.35	-29.39	-29.60	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-30.50	-1.00	-29.70	-30.94	-32.41	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-16.75	-2.00	-17.29	-22.48	-29.09	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1130.50 (+5.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-37.00	2.75	1Y	1.3700	2.00	1.3700	0.7650	1*2Y	7.00	1.50	
-45.50	4.25	1.5Y	1.4000	3.00	1.4000	0.8100	2*3Y	7.00	0.50	
-49.50	5.00	2Y	1.4400	3.50	1.4400	0.7950	2*5Y	20.00	0.00	
-53.00	6.00	3Y	1.5100	4.00	1.5100	0.7350	3*4Y	7.00	-0.50	
-53.00	5.50	4Y	1.5800	3.50	1.5800	0.6900	3*5Y	13.00	-0.50	
-50.25	5.50	5Y	1.6400	3.50	1.6400	0.6600	4*5Y	6.00	0.00	
-47.25	3.25	7Y	1.7150	1.00	1.7150	0.6550	5*7Y	7.50	-2.50	
-36.50	3.00	10Y	1.8650	0.50	1.8650	0.6300	5*10Y	22.50	-3.00	

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	1.5955	-2.34	1.6189	1.6029	1.5810	1.7169	0.5600	1.7169	0.2600
10Y	2.4095	-5.44	2.4639	2.4347	2.4165	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	-0.5225	-2.14	-0.5011	-0.4471	-0.4060	0.1019	-0.7050	0.1019	-2.6400
10Y	-0.1255	-3.94	-0.0861	-0.0713	-0.0405	0.4740	-0.2446	0.4740	-1.1700

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	29.50	-1.00	30.50	29.50	26.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	41.70	-1.30	43.00	45.60	47.00	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	81.40	-3.10	84.50	83.18	83.55	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS				ODD Tenor						
06M										
09M										
01Y	73.5	76.25	77.25		77	76	74			
1.5Y	85.5									
02Y	93.75	98.5	96	95.5	SPRD	10/15y/3.5				
03Y	4.75					10/15y/3.75				
04Y	15.75					10*12y/03				
05Y	20	18.25				2*3y/11				
07Y						1*5y/42				
10Y	23.75	27				2*5y/21.5				
12Y										
15Y	27.5	30.75								
20Y	28.75									
CRS	2y/43.5 3y/51									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			177 건	5	172	194	202	179	235	145
금 액			52,312 억원	-2,189	54,501	59,926	61,897	88,162	86,971	73,737

장중동향

IRS가 하락. 단기보다 장기 금리가 더 내리면서 수익률 곡선은 평탄해짐. IRS 금리는 국채선물 움직임에 따라 크게 움직이면서 장중 변동 폭이 너무 컸음

CRS 금리는 상승 마감. 특별한 거래 소식은 없었으나 당분간 계속 오를 수밖에 없는 상황으로 보임.