

IPS Daily Morning Brief

2017-11-08

종가 기준일 2017-11-07

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.5525	0.00	1.5545	1.5278	1.4702	1.5700	1.2875	2.7525	1.2875
9M	1.6650	0.00	1.6685	1.6253	1.5371	1.6825	1.2500	2.7650	1.2500
1Y	1.7525	-0.25	1.7595	1.7110	1.6004	1.7800	1.2200	2.7775	1.2200
1.5Y	1.8625	-1.00	1.8710	1.8159	1.6810	1.8925	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	1.9475	-1.50	1.9530	1.8884	1.7393	1.9725	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0400	-2.00	2.0445	1.9779	1.8227	2.0675	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.0975	-2.25	2.1025	2.0348	1.8769	2.1325	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1325	-2.25	2.1390	2.0725	1.9168	2.1700	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.1700	-2.50	2.1810	2.1168	1.9677	2.2200	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2175	-2.75	2.2320	2.1736	2.0398	2.2750	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2475	-2.75	2.2590	2.2028	2.0708	2.3000	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2525	-2.75	2.2640	2.2121	2.0817	2.3050	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2600	-2.50	2.2720	2.2233	2.0947	2.3150	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	11.25	0.00	11.40	9.75	6.69	12.50	-4.75	12.50	-6.00
9*12M	8.75	-0.25	9.10	8.58	6.33	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	19.50	-1.25	19.35	17.74	13.90	20.75	-5.50	20.75	-5.50
2*3Y	9.25	-0.50	9.15	8.95	8.34	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	15.00	-0.75	14.95	14.64	13.75	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.50	-0.75	18.60	18.41	17.75	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	-0.25	5.80	5.69	5.42	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.25	-0.25	9.45	9.46	9.41	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.65	3.78	3.99	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	3.75	-0.25	4.20	4.43	5.09	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	8.50	-0.50	9.30	10.11	12.30	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	4.75	-0.25	5.10	5.69	7.20	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	2.70	2.91	3.10	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.20	3.85	4.20	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.25	0.25	4.00	4.96	5.50	9.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.799	-1.90	1.830	1.764	1.596	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	1.987	-1.30	2.004	1.905	1.733	2.037	1.232	2.830	1.232
2Y	2.080	-2.00	2.089	1.995	1.820	2.132	1.225	2.920	1.225
3Y	2.130	-2.60	2.137	2.059	1.888	2.187	1.200	3.050	1.200
4Y	2.310	-3.00	2.321	2.231	2.036	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.355	-3.50	2.368	2.282	2.097	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.489	-2.40	2.493	2.417	2.266	2.525	1.270	3.590	1.270
10Y	2.537	-1.80	2.537	2.478	2.361	2.576	1.355	3.750	1.355
20Y	2.502	-2.30	2.508	2.439	2.373	2.553	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.40	0.00
CALL	1.24	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.96	0.11	107.90	107.97	107.83
LKTb	121.38	0.23	121.31	121.45	121.11

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	-4.65	1.65	-7.09	-5.28	0.46	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-12.45	0.30	-13.28	-8.89	-5.21	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-13.25	0.50	-13.58	-10.68	-8.04	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-9.00	0.60	-9.27	-8.12	-6.50	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-21.25	0.75	-21.83	-19.67	-15.96	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-22.25	1.25	-22.92	-20.99	-18.05	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.90	-0.10	-31.24	-30.07	-29.81	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.95	-0.95	-30.52	-30.42	-32.11	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-24.20	-0.20	-23.56	-21.56	-27.87	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1111.90 (-3.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-30.75	-1.75	1Y	1.4450	-2.00	1.4650	0.7650	1*2Y	6.00	1.00	
-39.75	-1.00	1.5Y	1.4650	-2.00	1.4850	0.8950	2*3Y	7.00	0.00	
-44.25	0.50	2Y	1.5050	-1.00	1.5150	0.7950	2*5Y	17.00	0.00	
-46.50	1.00	3Y	1.5750	-1.00	1.5850	0.7350	3*4Y	5.00	0.00	
-47.25	1.25	4Y	1.6250	-1.00	1.6350	0.6900	3*5Y	10.00	0.00	
-45.75	1.25	5Y	1.6750	-1.00	1.6950	0.6600	4*5Y	5.00	0.00	
-44.50	1.50	7Y	1.7250	-1.00	1.7700	0.6550	5*7Y	5.00	0.00	
-33.75	1.75	10Y	1.8800	-1.00	1.9250	0.6300	5*10Y	20.50	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	1.6329	0.0122	1.6207	1.6125	1.6160	1.7169	0.5600	1.7169	0.2800
10Y	2.3166	0.0010	2.3156	2.3337	2.3489	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	-44.71	3.22	-47.93	-48.25	-46.40	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-22.04	1.90	-23.94	-19.83	-17.11	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	-1.25	28.25	27.75	27.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	45.70	0.20	45.50	43.70	44.00	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	68.37	-1.12	69.49	72.12	73.29	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	66								
01Y	75.5 / 76								
1.5Y	87.5								
02Y		SPRD	6*12M	20					
03Y	5		1*5Y	38.75					
04Y	10 / 10.25		1.5*2Y	8.5					
05Y	13.5 / 13.75 / 14.5 / 14.75		2*3Y	09 / 9.25					
07Y			3*10Y	17.75 / 18					
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	115 건	67	48	106	98	171	135	135	
금 액	34,081 억원	18,666	15,415	34,670	23,400	66,552	49,690	41,384	

장종동향

국고채 금리 하락. 국채선물은 3년을 중심으로 외국인 매수세 확대.

IRS, 단기보다 장기금리가 더 하락하면서 커브 플레트닝 마감.
단기 구간으로 비디쉬, 중기 이상 구간으로 오퍼리시. 장중 10월 금통위 의사록 공개를 앞둔 경계감 작용. 오후 4시 의사록 공개 이후 막판에 거래가 다수 이어졌던 장.

CRS 금리도 전구간 하락 마감.