

IPS Daily Morning Brief

2017-11-09

종가 기준일 2017-11-08

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.5650	1.25	1.5555	1.5323	1.4723	1.5700	1.2875	2.7525	1.2875
9M	1.6775	1.25	1.6685	1.6323	1.5403	1.6825	1.2500	2.7650	1.2500
1Y	1.7650	1.25	1.7585	1.7190	1.6042	1.7800	1.2200	2.7775	1.2200
1.5Y	1.8750	1.25	1.8700	1.8246	1.6855	1.8925	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	1.9600	1.25	1.9540	1.8979	1.7444	1.9725	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0525	1.25	2.0465	1.9876	1.8279	2.0675	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.1050	0.75	2.1025	2.0444	1.8820	2.1325	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1350	0.25	2.1375	2.0815	1.9217	2.1700	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.1675	-0.25	2.1760	2.1245	1.9722	2.2200	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2125	-0.50	2.2255	2.1796	2.0435	2.2750	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2425	-0.50	2.2535	2.2086	2.0745	2.3000	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2475	-0.50	2.2585	2.2176	2.0853	2.3050	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2500	-1.00	2.2650	2.2283	2.0980	2.3150	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	11.25	0.00	11.30	10.00	6.80	12.50	-4.75	12.50	-6.00
9*12M	8.75	0.00	9.00	8.68	6.40	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	19.50	0.00	19.55	17.89	14.02	20.75	-5.50	20.75	-5.50
2*3Y	9.25	0.00	9.25	8.98	8.35	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.50	-0.50	14.85	14.65	13.76	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.50	-1.00	18.35	18.36	17.73	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	-0.50	5.60	5.68	5.41	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.25	-1.00	9.10	9.39	9.38	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.00	-0.50	3.50	3.71	3.97	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	3.25	-0.50	3.85	4.30	5.05	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	7.75	-0.75	8.80	9.81	12.18	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	4.50	-0.25	4.95	5.51	7.13	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	2.80	2.90	3.10	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.30	3.80	4.18	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	-0.50	3.95	4.86	5.45	9.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.805	0.60	1.818	1.774	1.601	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	1.999	1.20	1.999	1.918	1.739	2.037	1.232	2.830	1.232
2Y	2.100	2.00	2.091	2.010	1.826	2.132	1.225	2.920	1.225
3Y	2.145	1.50	2.139	2.070	1.893	2.187	1.200	3.050	1.200
4Y	2.316	0.60	2.321	2.243	2.043	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.355	0.00	2.366	2.294	2.103	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.486	-0.30	2.492	2.426	2.271	2.525	1.270	3.590	1.270
10Y	2.532	-0.50	2.535	2.484	2.364	2.576	1.355	3.750	1.355
20Y	2.500	-0.20	2.503	2.445	2.375	2.553	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.40	0.00
CALL	1.23	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.94	-0.02	107.97	107.99	107.85
LKTb	121.49	0.11	121.42	121.65	121.30

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	-4.00	0.65	-5.99	-5.46	0.36	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-12.40	0.05	-12.92	-9.31	-5.31	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-14.00	-0.75	-13.70	-11.19	-8.15	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-9.25	-0.25	-9.27	-8.26	-6.53	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-21.10	0.15	-21.81	-19.84	-16.09	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-22.00	0.25	-22.85	-21.22	-18.11	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.85	0.05	-31.58	-30.15	-29.84	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.95	0.00	-30.97	-30.39	-32.07	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-25.00	-0.80	-23.76	-21.63	-27.73	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1115.60 (+3.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-29.50	1.25	1Y	1.4700	2.50	1.4700	0.7650	1*2Y	7.00	1.00	
-38.00	1.75	1.5Y	1.4950	3.00	1.4950	0.8950	2*3Y	6.50	-0.50	
-42.00	2.25	2Y	1.5400	3.50	1.5400	0.7950	2*5Y	16.00	-1.00	
-44.75	1.75	3Y	1.6050	3.00	1.6050	0.7350	3*4Y	5.00	0.00	
-45.00	2.25	4Y	1.6550	3.00	1.6550	0.6900	3*5Y	9.50	-0.50	
-43.50	2.25	5Y	1.7000	2.50	1.7000	0.6600	4*5Y	4.50	-0.50	
-42.75	1.75	7Y	1.7400	1.50	1.7700	0.6550	5*7Y	4.00	-1.00	
-32.75	1.00	10Y	1.8850	0.50	1.9250	0.6300	5*10Y	18.50	-2.00	

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	1.6574	0.0245	1.6329	1.6207	1.6125	1.7169	0.5600	1.7169	0.2800
10Y	2.3328	0.0162	2.3166	2.3156	2.3337	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	-44.26	0.45	-44.71	-47.93	-48.25	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-19.92	2.12	-22.04	-23.94	-19.83	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	25.25	-1.75	27.00	28.25	27.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	43.20	-2.50	45.70	45.50	43.70	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	67.54	-0.83	68.37	69.49	72.12	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
	06M	57							
	09M								
	01Y								
	1.5Y								
	02Y				SPRD	6*12M	19.75		
	03Y	5.5				9*12M	8.75		
	04Y					3*10Y	16		
	05Y	13 / 13.25				5*10Y	08		
	07Y								
10Y	21								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3Y 60.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	123 건	8	115	48	106	98	171	135	
금 액	42,715 억원	8,634	34,081	15,415	34,670	23,400	66,552	49,690	

장중동향
국고채 금리, 보험권 혼조.
전일 장 마감 후 공개된 10월 금통위 의사록 뿐 아니라 도널드 트럼프 미 대통령의 대북발언, 기재부의 제도 개선 방안, 한은 금통위원의 통화정책 발언 등 다양한 재료의 영향을 받음.

IRS, 중단기 구간 금리 상승, 장기구간 금리 하락. 커브 플랫트닝.
단기 테너가 비디쉬했던 반면, 장기 테너가 오퍼리시한 분위기 형성.

CRS, 부채 스왑 영향을 받으며 금리 상승 마감.