IPS Daily Morning Brief

2017-11-10

종가 기준일 2017-11-09

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.5650	0.00	1.5575	1.5371	1.4745	1.5700	1.2875	2.7525	1.2875
9M	1.6775	0.00	1.6700	1.6394	1.5435	1.6825	1.2500	2.7650	1.2500
1Y	1.7675	0.25	1.7595	1.7274	1.6082	1.7800	1.2200	2.7775	1.2200
1.5Y	1.8775	0.25	1.8715	1.8340	1.6903	1.8925	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	1.9625	0.25	1.9575	1.9085	1.7497	1.9725	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0500	-0.25	2.0500	1.9984	1.8332	2.0675	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.1050	0.00	2.1060	2.0551	1.8873	2.1325	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1350	0.00	2.1395	2.0915	1.9268	2.1700	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.1750	0.75	2.1775	2.1338	1.9769	2.2200	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2200	0.75	2.2255	2.1871	2.0475	2.2750	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2525	1.00	2.2550	2.2161	2.0785	2.3000	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2600	1.25	2.2605	2.2249	2.0892	2.3050	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2625	1.25	2.2655	2.2350	2.1015	2.3150	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	11.25	0.00	11.25	10.23	6.90	12.50	-4.75	12.50	-6.00
9*12M	9.00	0.25	8.95	8.80	6.47	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	19.50	0.00	19.80	18.11	14.15	20.75	-5.50	20.75	-5.50
2*3Y	8.75	-0.50	9.25	8.99	8.35	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.25	-0.25	14.85	14.66	13.75	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.25	-0.25	18.20	18.30	17.71	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.25	5.60	5.68	5.40	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.50	0.25	8.95	9.31	9.36	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.00	0.00	3.35	3.64	3.95	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.75	3.80	4.23	5.01	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	8.50	0.75	8.60	9.56	12.07	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	4.50	0.00	4.80	5.34	7.05	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.25	2.95	2.90	3.10	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.50	3.50	3.78	4.18	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.25	0.50	4.00	4.79	5.41	9.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.806	0.10	1.811	1.783	1.605	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	2.006	0.70	1.998	1.931	1.744	2.037	1.232	2.820	1.232
2Y	2.107	0.70	2.096	2.023	1.832	2.132	1.225	2.920	1.225
3Y	2.146	0.10	2.144	2.083	1.899	2.187	1.200	3.050	1.200
4Y	2.310	-0.60	2.322	2.255	2.050	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.345	-1.00	2.365	2.306	2.108	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.487	0.10	2.494	2.436	2.276	2.525	1.270	3.590	1.270
10Y	2.540	0.80	2.539	2.492	2.368	2.576	1.355	3.750	1.355
20Y	2.500	0.00	2.505	2.451	2.377	2.553	1.430	3.943	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.93	-0.01	107.92	107.96	107.88
LKTB	121.39	-0.10	121.40	121.53	121.21

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	-3.85	0.15	-5.15	-5.55	0.27	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-12.85	-0.45	-12.67	-9.66	-5.42	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-14.45	-0.45	-13.89	-11.49	-8.28	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-9.60	-0.35	-9.44	-8.44	-6.59	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-20.50	0.60	-21.56	-20.01	-16.23	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-21.00	1.00	-22.55	-21.44	-18.17	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.20	0.65	-31.67	-30.26	-29.86	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.00	-0.05	-31.37	-30.44	-32.04	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-23.75	1.25	-23.97	-21.58	-27.56	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-29.25	0.25
-36.25	1.75
-40.75	1.25
-43.00	1.75
-43.00	2.00
-41.50	2.00
-41.00	1.75
-31.00	1.75

CRS

USD/KRW 1115.60 (0.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.4750	0.50	1.4750	0.7650	1*2Y	8.00	1.00
1.5Y	1.5150	2.00	1.5150	0.8950	2*3Y	6.50	0.00
2Y	1.5550	1.50	1.5550	0.7950	2*5Y	16.50	0.50
3Y	1.6200	1.50	1.6200	0.7350	3*4Y	5.50	0.50
4Y	1.6750	2.00	1.6750	0.6900	3*5Y	10.00	0.50
5Y	1.7200	2.00	1.7200	0.6600	4*5Y	4.50	0.00
7Y	1.7650	2.50	1.7700	0.6550	5*7Y	4.50	0.50
10Y	1.9100	2.50	1.9250	0.6300	5*10Y	19.00	0.50

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	1.6414	-0.0160	1.6574	1.6329	1.6207	1.7169	0.5600	1.7169	0.2800
10Y	2.3256	-0.0072	2.3328	2.3166	2.3156	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	-46.56	-2.3	-44.26	-44.71	-47.93	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-21.44	-1.52	-19.92	-22.04	-23.94	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	25.75	0.50	25.25	27.00	28.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	43.30	0.10	43.20	45.70	45.50	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	68.42	0.88	67.54	68.37	69.49	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			9y/21.5
06M	57.25	ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	88.25		
02Y	97.5 96.75 96	SPRD	5*12y/12.5
03Y	6		5*15y/12.5
04Y			5*9y/7.25
05Y	14.5 13.25		2*5y/17.25
07Y	17.75		7*9y/3.75
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3y/1.62 4y/1.6750 5y/1.72 3*4y/5.5 4*5y/4.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	127 건	4	123	115	48	106	98	171
금 액	39,423 억원	-3,292	42,715	34,081	15,415	34,670	23,400	66,552

장중동향

IRS가 장·단기 구간에서 약보합세를 나타냄. 3~5년 구간은 상대적으로 강한 모습을 보임.
장중 국채선물의 변동성이 컸는데, 이에 비해 IRS의 변동 폭은 크지 않았음. 단기는 11월 인상을 앞두고 약보합세를 보임. 다만 3년 이상 구간에서는 커브가 가팔라짐. 장기 구간은 외국인이 10년 국채선물을 매도한 영향을 받은 듯함.

CRS 금리도 상승. 별다른 거래는 없었으며 리보금리 상승 영향을 받은 듯함.