

IPS Daily Morning Brief

2017-11-14

종가 기준일 2017-11-13

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.5825	1.50	1.5665	1.5464	1.4792	1.5825	1.2875	2.7325	1.2875
9M	1.6900	1.25	1.6775	1.6520	1.5501	1.6900	1.2500	2.7450	1.2500
1Y	1.7800	1.25	1.7665	1.7425	1.6164	1.7800	1.2200	2.7675	1.2200
1.5Y	1.8925	1.25	1.8775	1.8515	1.7000	1.8925	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	1.9800	1.25	1.9635	1.9285	1.7607	1.9800	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0725	1.50	2.0545	2.0193	1.8444	2.0725	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.1300	1.50	2.1105	2.0764	1.8984	2.1325	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1650	1.75	2.1430	2.1115	1.9376	2.1700	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.2050	1.75	2.1810	2.1526	1.9870	2.2200	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2600	1.50	2.2310	2.2043	2.0565	2.2750	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2950	1.75	2.2630	2.2334	2.0876	2.3000	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.3025	1.65	2.2697	2.2417	2.0981	2.3050	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.3000	1.50	2.2715	2.2504	2.1096	2.3150	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	10.75	-0.25	11.10	10.56	7.10	12.50	-4.75	12.50	-6.00
9*12M	9.00	0.00	8.90	9.05	6.63	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	20.00	0.00	19.70	18.60	14.43	20.75	-5.50	20.75	-5.50
2*3Y	9.25	0.25	9.10	9.08	8.38	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	15.00	0.25	14.70	14.79	13.78	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.50	0.50	17.95	18.30	17.70	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	0.00	5.60	5.71	5.40	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.25	0.25	8.85	9.23	9.32	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.25	3.25	3.51	3.92	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.00	3.80	4.11	4.94	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	9.50	-0.25	8.80	9.28	11.89	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	5.50	-0.25	5.00	5.16	6.95	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.25	3.20	2.91	3.11	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.15	3.87	3.74	4.16	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	0.00	4.05	4.61	5.31	9.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.815	0.50	1.807	1.800	1.616	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	2.015	0.80	2.003	1.955	1.757	2.037	1.232	2.820	1.232
2Y	2.145	2.30	2.111	2.052	1.847	2.145	1.225	2.920	1.225
3Y	2.177	2.00	2.151	2.107	1.912	2.187	1.200	3.050	1.200
4Y	2.331	1.90	2.316	2.279	2.064	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.380	2.80	2.357	2.330	2.121	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.526	2.20	2.498	2.458	2.287	2.526	1.270	3.590	1.270
10Y	2.587	1.70	2.553	2.510	2.377	2.587	1.355	3.750	1.355
20Y	2.527	2.10	2.507	2.464	2.382	2.553	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.41	1.00
CALL	1.23	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.83	-0.07	107.86	107.86	107.81
LKTB	120.94	-0.16	120.84	121.00	120.62

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	-3.50	0.75	-4.05	-5.79	0.06	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-12.25	0.45	-12.53	-10.37	-5.68	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-16.50	-1.05	-14.73	-12.31	-8.59	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-10.45	-0.50	-9.65	-8.78	-6.74	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-20.10	-0.40	-20.53	-20.29	-16.51	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-21.50	-1.05	-21.44	-21.85	-18.31	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.10	-0.45	-31.74	-30.51	-29.96	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.70	-0.20	-32.22	-30.54	-32.02	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-22.70	-0.60	-23.55	-21.34	-27.20	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1120.60 (+3.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-26.00	1.25	1Y	1.5200	2.50	1.5200	0.7650	1*2Y	7.50	-1.50	
-33.75	0.25	1.5Y	1.5550	1.50	1.5550	0.8950	2*3Y	7.50	1.00	
-38.50	-0.25	2Y	1.5950	1.00	1.5950	0.7950	2*5Y	17.50	0.50	
-40.25	0.50	3Y	1.6700	2.00	1.6700	0.7350	3*4Y	5.00	-0.50	
-41.00	0.00	4Y	1.7200	1.50	1.7200	0.6900	3*5Y	10.00	-0.50	
-39.50	-0.25	5Y	1.7700	1.50	1.7700	0.6600	4*5Y	5.00	0.00	
-37.50	0.25	7Y	1.8300	2.00	1.8300	0.6550	5*7Y	6.00	0.50	
-28.50	0.50	10Y	1.9750	2.00	1.9750	0.6300	5*10Y	20.50	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	1.6951	0.0391	1.6560	1.6414	1.6574	1.7169	0.5600	1.7169	0.2800
10Y	2.4055	0.0069	2.3986	2.3256	2.3328	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	-44.99	1.61	-46.60	-46.56	-44.26	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-18.15	-1.01	-17.14	-21.44	-19.92	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	28.00	0.25	27.75	25.75	25.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	44.20	-0.60	44.80	43.30	43.20	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	71.04	-3.22	74.26	68.42	67.54	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	58									
09M										
01Y	77.5									
1.5Y	89.5									
02Y	98.5	98.25				SPRD	1.5*2y/09			
03Y					6*12m/19.5					
04Y					5*10y/9.75					
05Y	17.25	16.75			10*15y/04					
07Y										
10Y	26.5									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			67 건	-3	70	127	123	115	48	106
금 액			21,940 억원	-1,637	23,577	39,423	42,715	34,081	15,415	34,670

장중동향
IRS가 국채선물에 연동해서 상승 마감. 국채선물이 갭 하락하면서 시작했는데, 이에 영향을 받아 IRS 금리도 장중 스틱땀음. 그러나 IRS 뒤쪽 구간에서 오픈가 나오면서 플랫으로 마감.

CRS 금리도 상승. 장중에 많이 올라가다 장 후반부터 빠지는 모습을 보인후 마감.