IPS Daily Morning Brief

2017-11-15

종가 기준일 2017-11-14

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6100	2.75	1.5780	1.5521	1.4819	1.6100	1.2875	2.7250	1.2875
9M	1.7250	3.50	1.6895	1.6594	1.5539	1.7250	1.2500	2.7375	1.2500
1Y	1.8200	4.00	1.7800	1.7511	1.6210	1.8200	1.2200	2.7675	1.2200
1.5Y	1.9300	3.75	1.8910	1.8613	1.7053	1.9300	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	2.0175	3.75	1.9775	1.9395	1.7666	2.0175	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.1075	3.50	2.0680	2.0309	1.8504	2.1075	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.1600	3.00	2.1230	2.0881	1.9045	2.1600	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1900	2.50	2.1545	2.1224	1.9434	2.1900	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.2300	2.50	2.1930	2.1631	1.9925	2.2300	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2850	2.50	2.2445	2.2141	2.0615	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.3200	2.50	2.2775	2.2434	2.0927	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.3275	2.50	2.2847	2.2514	2.1030	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.3250	2.50	2.2845	2.2594	2.1141	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	11.50	0.75	11.15	10.73	7.20	12.50	-4.50	12.50	-6.00
9*12M	9.50	0.50	9.05	9.18	6.71	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	19.75	-0.25	19.75	18.84	14.56	20.75	-5.50	20.75	-5.50
2*3Y	9.00	-0.25	9.05	9.14	8.38	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.25	-0.75	14.55	14.86	13.79	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.25	-1.25	17.70	18.29	17.68	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	-0.50	5.50	5.73	5.40	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.25	-1.00	8.65	9.15	9.30	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.00	-0.50	3.15	3.43	3.90	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.00	3.85	4.08	4.91	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	9.50	0.00	9.00	9.18	11.81	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	5.50	0.00	5.15	5.10	6.90	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.00	3.30	2.93	3.11	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.02	3.73	4.15	6.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	0.00	4.00	4.53	5.26	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	0.00	1.810	1.808	1.621	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	2.024	0.90	2.010	1.968	1.763	2.037	1.232	2.820	1.232
2Y	2.165	2.00	2.128	2.067	1.854	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.206	2.90	2.166	2.120	1.919	2.206	1.200	3.050	1.200
4Y	2.359	2.80	2.326	2.292	2.071	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.415	3.50	2.369	2.344	2.127	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.552	2.60	2.511	2.470	2.293	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.607	2.00	2.567	2.520	2.382	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.572	4.50	2.521	2.473	2.385	2.572	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.42	1.00
CALL	1.22	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.22	-0.61	107.82	107.84	107.69
LKTB	120.70	-0.24	120.92	120.99	120.66

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	0.50	4.00	-3.02	-5.73	0.01	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-9.40	2.85	-11.92	-10.64	-5.76	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-14.75	1.75	-15.03	-12.70	-8.72	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-9.85	0.60	-9.82	-8.92	-6.81	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-19.90	0.20	-20.26	-20.43	-16.65	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-22.50	-1.00	-21.49	-22.11	-18.41	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.20	-0.10	-31.80	-30.67	-30.02	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.20	0.50	-32.27	-30.59	-32.02	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-24.70	-2.00	-23.65	-21.35	-27.08	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-24.50	1.50
-33.00	0.75
-38.25	0.25
-40.75	-0.50
-41.00	0.00
-39.00	0.50
-37.50	0.00
-29.00	-0.50

CRS

USD/KRW 1118.10 (-2.50)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.5750	5.50	1.5750	0.7650	1*2Y	6.00	-1.50
1.5Y	1.6000	4.50	1.6000	0.8950	2*3Y	6.50	-1.00
2Y	1.6350	4.00	1.6350	0.7950	2*5Y	16.50	-1.00
3Y	1.7000	3.00	1.7000	0.7350	3*4Y	5.00	0.00
4Y	1.7500	3.00	1.7500	0.6900	3*5Y	10.00	0.00
5Y	1.8000	3.00	1.8000	0.6600	4*5Y	5.00	0.00
7Y	1.8550	2.50	1.8550	0.6550	5*7Y	5.50	-0.50
10Y	1.9950	2.00	1.9950	0.6300	5*10Y	19.50	-1.00

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	1.6913	-0.0038	1.6951	1.6560	1.6414	1.7169	0.5600	1.7169	0.2800
10Y	2.3735	-0.0320	2.4055	2.3986	2.3256	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	-47.37	-2.38	-44.99	-46.60	-46.56	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-23.35	-5.20	-18.15	-17.14	-21.44	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	26.75	-1.25	28.00	27.75	25.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	44.20	0.00	44.20	44.80	43.30	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	68.22	-2.82	71.04	74.26	68.42	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	58.25 / 59.75 / 60	ODD Tenor	
09M	69 / 69.5		
01Y	78.5 / 79 / 80.5		
1.5Y			
02Y	99 / 1.5	SPRD	6*9m 10.75
03Y	08 / 9.25		1.5*3y 18
04Y			2*7y 22.5
05Y	17.5 / 18.25 / 19		
07Y			6*9*12m fly 1.75
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	120 건	53	67	70	127	123	115	48
금 액	49,217 억원	27,277	21,940	23,577	39,423	42,715	34,081	15,415

장중동향

보합권에서 움직이던 채권은 오후 기재부의 바이백 취소 공지에 낙폭을키우며 하락 마감.

IRS는 오전에 조용한 가운데 단기물 거래가 주를 이뤘고 9개월, 1년이 비디쉬. 오후들어 기재부의 바이백 취소 공고에 채권과 연동해 상승. 하루종일 단기는 비디시했고 커브는 단기물 스팁, 그 뒤 구간으로는 플랫 마감.

CRS는 리보금리가 오르고있어 단기구간 비드가 우세, 레벨 상승 마감.