

IPS Daily Morning Brief

2017-11-17

종가 기준일 2017-11-16

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6150	0.50	1.5970	1.5619	1.4877	1.6150	1.2875	2.7225	1.2875
9M	1.7250	0.50	1.7075	1.6709	1.5615	1.7250	1.2500	2.7375	1.2500
1Y	1.8175	0.50	1.7995	1.7643	1.6302	1.8200	1.2200	2.7675	1.2200
1.5Y	1.9175	0.50	1.9065	1.8753	1.7155	1.9300	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	2.0025	0.75	1.9925	1.9560	1.7779	2.0175	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0875	1.00	2.0805	2.0476	1.8619	2.1075	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.1425	1.75	2.1345	2.1051	1.9159	2.1600	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1700	1.50	2.1655	2.1385	1.9543	2.1900	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.2025	1.25	2.2030	2.1780	2.0026	2.2300	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2575	1.25	2.2585	2.2286	2.0707	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2950	1.50	2.2935	2.2583	2.1020	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.3000	1.50	2.3002	2.2656	2.1120	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2950	1.50	2.2970	2.2716	2.1221	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	11.00	0.00	11.05	10.90	7.38	12.50	-4.50	12.50	-6.00
9*12M	9.25	0.00	9.20	9.34	6.87	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	18.50	0.25	19.30	19.18	14.78	20.75	-5.50	20.75	-5.50
2*3Y	8.50	0.25	8.80	9.16	8.40	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.00	1.00	14.20	14.91	13.80	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.75	0.75	17.30	18.25	17.64	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.75	5.40	5.75	5.40	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.25	0.50	8.50	9.09	9.25	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	2.75	-0.25	3.10	3.34	3.84	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	3.25	-0.25	3.75	3.95	4.83	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	8.75	-0.25	9.30	9.01	11.64	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	5.50	0.00	5.55	5.06	6.81	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.25	3.50	2.96	3.13	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.25	4.17	3.69	4.13	5.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	0.25	3.85	4.30	5.14	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.826	1.00	1.816	1.821	1.631	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	2.026	1.10	2.017	1.990	1.775	2.037	1.232	2.820	1.232
2Y	2.152	1.80	2.144	2.092	1.868	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.190	2.00	2.180	2.141	1.931	2.206	1.200	3.050	1.200
4Y	2.345	1.50	2.335	2.314	2.085	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.387	1.20	2.382	2.364	2.140	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.521	0.90	2.523	2.489	2.304	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.575	0.80	2.581	2.536	2.391	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.572	1.20	2.547	2.490	2.391	2.572	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.44	1.00
CALL	1.22	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.81	-0.07	107.90	107.92	107.81
LKTb	121.09	-0.11	121.30	121.38	121.09

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	-0.85	-0.50	-1.69	-5.63	-0.11	9.00	-17.75	11.25	-17.75
1.5Y	-10.85	-0.60	-11.09	-11.43	-5.96	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-14.95	-1.05	-15.11	-13.62	-8.97	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-10.25	-1.00	-9.95	-9.34	-6.94	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-20.25	0.25	-20.09	-20.84	-16.94	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-21.70	0.30	-21.63	-22.56	-18.60	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.85	0.35	-32.00	-31.06	-30.15	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.75	0.45	-32.27	-30.76	-32.04	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-27.70	0.30	-25.04	-21.87	-26.90	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1101.40 (-10.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-21.25	3.00	1Y	1.6050	3.50	1.6050	0.7650	1*2Y	7.50	1.00		
-27.25	4.00	1.5Y	1.6450	4.50	1.6450	0.8950	2*3Y	6.00	-0.50		
-32.25	3.75	2Y	1.6800	4.50	1.6800	0.7950	2*5Y	15.50	-1.00		
-34.75	3.00	3Y	1.7400	4.00	1.7400	0.7350	3*4Y	4.50	-0.50		
-35.75	1.75	4Y	1.7850	3.50	1.7850	0.6900	3*5Y	9.50	-0.50		
-33.50	2.00	5Y	1.8350	3.50	1.8350	0.6600	4*5Y	5.00	0.00		
-32.25	1.25	7Y	1.8800	2.50	1.8800	0.6550	5*7Y	4.50	-1.00		
-24.25	0.75	10Y	2.0150	2.00	2.0150	0.6300	5*10Y	18.00	-1.50		

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	1.7123	0.0289	1.6834	1.6913	1.6951	1.7169	0.5600	1.7169	0.2800
10Y	2.3762	0.0505	2.3257	2.3735	2.4055	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	-43.97	1.09	-45.06	-47.37	-44.99	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-19.88	4.25	-24.13	-23.35	-18.15	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	25.50	0.50	25.00	26.75	28.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	42.30	-1.00	43.30	44.20	44.20	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	66.39	2.16	64.23	68.22	71.04	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	61.5									
09M	72.25									
01Y	81.5 82									
1.5Y	92 91.5 91									
02Y	99.5 99.25 00 99.5 99.25				SPRD	3*10y/16.25				
03Y	7.5 8.25 08 7.75					3*10y/16.5				
04Y						10*15y/04				
05Y						9*12m/9.25				
07Y						2*3y/8.25				
10Y	24.5					2*7y/19				
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			127 건	-25	152	120	67	70	127	123
금 액			39,585 억원	-6,204	45,789	49,217	21,940	23,577	39,423	42,715

장중동향

IRS 금리가 대부분 구간에서 소폭 상승. IRS는 CD 금리 상승과 기준금리 인상 전망에 따라 단기를 중심으로 비디쉬한 분위기가 다소 누그러짐. 커브 플래트닝 속도도 진정되고 있음.

CRS 금리도 상승 마감. CRS는 환율금락과 FX 스와이프포인트 상승으로 커브가 플래트닝됐고, 단기를 중심으로 비드가 나옴.