

IPS Daily Morning Brief

2017-11-20

종가 기준일 2017-11-17

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6100	-0.50	1.6055	1.5646	1.4907	1.6150	1.2875	2.7225	1.2875
9M	1.7175	-0.75	1.7155	1.6728	1.5654	1.7250	1.2500	2.7375	1.2500
1Y	1.8100	-0.75	1.8080	1.7658	1.6348	1.8200	1.2200	2.7675	1.2200
1.5Y	1.9050	-1.25	1.9115	1.8763	1.7206	1.9300	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	1.9800	-2.25	1.9950	1.9571	1.7836	2.0175	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0650	-2.25	2.0820	2.0489	1.8678	2.1075	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.1250	-1.75	2.1365	2.1078	1.9219	2.1600	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1550	-1.50	2.1670	2.1413	1.9601	2.1900	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.1925	-1.00	2.2040	2.1814	2.0080	2.2300	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2475	-1.00	2.2590	2.2323	2.0757	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2850	-1.00	2.2950	2.2621	2.1071	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2900	-1.00	2.3010	2.2692	2.1169	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2850	-1.00	2.2970	2.2744	2.1265	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	10.75	-0.25	11.00	10.81	7.47	12.50	-4.50	12.50	-6.00
9*12M	9.25	0.00	9.25	9.30	6.95	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	17.00	-1.50	18.70	19.14	14.88	20.75	-5.50	20.75	-5.50
2*3Y	8.50	0.00	8.70	9.18	8.41	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.50	0.50	14.15	15.06	13.83	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.50	0.75	17.20	18.41	17.65	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	6.00	0.50	5.45	5.89	5.41	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.00	0.75	8.50	9.24	9.23	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.00	0.25	3.05	3.35	3.82	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	3.75	0.50	3.70	4.01	4.80	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	9.25	0.50	9.20	9.10	11.56	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	5.50	0.00	5.50	5.09	6.77	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.60	2.99	3.14	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.20	3.69	4.12	5.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	0.00	3.80	4.21	5.08	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	0.00	1.820	1.821	1.637	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	2.014	-1.20	2.019	1.995	1.781	2.037	1.232	2.820	1.232
2Y	2.132	-2.00	2.146	2.099	1.875	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.172	-1.80	2.183	2.145	1.938	2.206	1.200	3.050	1.200
4Y	2.330	-1.50	2.339	2.318	2.093	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.381	-0.60	2.388	2.368	2.147	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.515	-0.60	2.525	2.493	2.310	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.570	-0.50	2.581	2.541	2.396	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.560	-1.20	2.558	2.499	2.395	2.572	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.45	1.00
CALL	1.23	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.86	0.05	107.81	107.89	107.80
LKTb	121.15	0.06	121.10	121.27	121.05

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	-1.60	-0.75	-1.16	-5.57	-0.20	9.00	-17.75	11.25	-17.75
1.5Y	-10.90	-0.05	-10.73	-11.87	-6.09	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-15.20	-0.25	-15.06	-14.16	-9.13	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-10.70	-0.45	-10.10	-9.64	-7.06	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-20.50	-0.25	-20.25	-21.01	-17.12	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-22.60	-0.90	-22.06	-22.66	-18.72	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.25	-0.40	-32.12	-31.20	-30.24	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.25	-0.50	-32.22	-30.90	-32.07	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-27.50	0.20	-26.12	-22.47	-26.81	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1097.50 (-3.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-19.00	2.25	1Y	1.6200	1.50	1.6200	0.7650	1*2Y	7.50	0.00	
-24.50	2.75	1.5Y	1.6600	1.50	1.6600	0.8950	2*3Y	6.00	0.00	
-28.50	3.75	2Y	1.6950	1.50	1.6950	0.7950	2*5Y	15.50	0.00	
-31.00	3.75	3Y	1.7550	1.50	1.7550	0.7350	3*4Y	4.50	0.00	
-32.50	3.25	4Y	1.8000	1.50	1.8000	0.6900	3*5Y	9.50	0.00	
-30.50	3.00	5Y	1.8500	1.50	1.8500	0.6600	4*5Y	5.00	0.00	
-29.75	2.50	7Y	1.8950	1.50	1.8950	0.6550	5*7Y	4.50	0.00	
-23.25	1.00	10Y	2.0150	0.00	2.0150	0.6300	5*10Y	16.50	-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	1.7213	0.0090	1.7123	1.6834	1.6913	1.7213	0.5600	1.7213	0.2800
10Y	2.3762	0.0000	2.3762	2.3257	2.3735	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	-41.07	2.9	-43.97	-45.06	-47.37	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-19.38	0.50	-19.88	-24.13	-23.35	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	25.50	25.00	26.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	43.80	1.50	42.30	43.30	44.20	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	65.49	-0.90	66.39	64.23	68.22	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	61 / 61.25									
09M										
01Y	81.25 / 81.5									
1.5Y	91.25									
02Y	98.5 / 99.25				SPRD	6*12m	20.25			
03Y	8					10*12y	3.75			
04Y	13.25					12*15y	0.5			
05Y										
07Y										
10Y										
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	1y 63									
	5y 85.5									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			78 건	-49	127	152	120	67	70	127
금 액			26,208 억원	-13,377	39,585	45,789	49,217	21,940	23,577	39,423

장종동향

채권은 예정된 국채매입이 예정대로 진행된다는 소식에 강세를 보이다가 막판 되돌리며 강보합 마감.

IRS는 2년~3년 구간으로 오퍼가 강하게 내려오면서 이 구간의 하락세가 눈에 뵈. 단기부터 2,3년까지는 플랫, 2,3년에서 장기쪽으로는 소폭 스킵 마감.

CRS는 레벨이 큰폭으로 오르다가 상승폭을 줄이며 마감.