

IPS Daily Morning Brief

2017-11-21

종가 기준일 2017-11-20

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6000	-1.00	1.6090	1.5685	1.4934	1.6150	1.2875	2.7225	1.2875
9M	1.7025	-1.50	1.7180	1.6765	1.5690	1.7250	1.2500	2.7375	1.2500
1Y	1.7900	-2.00	1.8100	1.7693	1.6391	1.8200	1.2200	2.7675	1.2200
1.5Y	1.8825	-2.25	1.9095	1.8790	1.7253	1.9300	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	1.9550	-2.50	1.9900	1.9601	1.7889	2.0175	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0425	-2.25	2.0760	2.0520	1.8733	2.1075	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.1000	-2.50	2.1305	2.1111	1.9275	2.1600	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1325	-2.25	2.1605	2.1448	1.9655	2.1900	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.1700	-2.25	2.1970	2.1851	2.0131	2.2300	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2250	-2.25	2.2520	2.2361	2.0804	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2650	-2.00	2.2890	2.2666	2.1119	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2700	-2.00	2.2945	2.2734	2.1215	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2650	-2.00	2.2900	2.2778	2.1306	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	10.25	-0.50	10.90	10.80	7.55	12.50	-4.50	12.50	-6.00
9*12M	8.75	-0.50	9.20	9.28	7.02	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	16.50	-0.50	18.00	19.09	14.98	20.75	-5.50	20.75	-5.50
2*3Y	8.75	0.25	8.60	9.19	8.44	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.50	0.00	14.05	15.10	13.85	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.75	0.25	17.05	18.46	17.66	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	-0.25	5.45	5.91	5.42	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.00	0.00	8.45	9.28	9.22	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.25	3.00	3.36	3.80	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	3.75	0.00	3.65	4.04	4.76	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	9.25	0.00	9.15	9.14	11.49	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	5.50	0.00	5.50	5.10	6.73	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.25	3.70	3.05	3.15	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.25	4.25	3.73	4.11	5.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	0.25	3.80	4.16	5.03	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.821	-0.50	1.821	1.824	1.642	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	2.004	-1.00	2.017	2.001	1.788	2.037	1.232	2.820	1.232
2Y	2.110	-2.20	2.139	2.106	1.882	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.152	-2.00	2.178	2.152	1.945	2.206	1.200	3.050	1.200
4Y	2.310	-2.00	2.335	2.324	2.100	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.357	-2.40	2.383	2.373	2.154	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.491	-2.40	2.518	2.499	2.316	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.545	-2.50	2.573	2.546	2.401	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.557	-0.30	2.564	2.508	2.398	2.572	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.46	1.00
CALL	1.23	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	107.94	0.08	107.88	107.95	107.87
LKTb	121.44	0.29	121.15	121.46	121.13

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-3.10	-1.50	-1.08	-5.45	-0.31	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-12.15	-1.25	-10.71	-12.21	-6.24	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-15.50	-0.30	-14.86	-14.63	-9.28	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-10.95	-0.25	-10.20	-9.96	-7.15	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-21.00	-0.50	-20.43	-21.27	-17.29	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-22.45	0.15	-22.25	-22.79	-18.84	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.10	0.15	-32.12	-31.35	-30.32	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-32.00	0.25	-32.08	-31.00	-32.09	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-29.20	-1.70	-27.42	-23.00	-26.74	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1100.60 (+3.10)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-19.50	-0.50	1Y	1.5950	-2.50	1.6200	0.7650	1*2Y	8.00	0.50
-24.75	-0.25	1.5Y	1.6350	-2.50	1.6600	0.8950	2*3Y	6.00	0.00
-28.00	0.50	2Y	1.6750	-2.00	1.6950	0.7950	2*5Y	15.50	0.00
-30.75	0.25	3Y	1.7350	-2.00	1.7550	0.7350	3*4Y	4.50	0.00
-32.00	0.50	4Y	1.7800	-2.00	1.8000	0.6900	3*5Y	9.50	0.00
-30.25	0.25	5Y	1.8300	-2.00	1.8500	0.6600	4*5Y	5.00	0.00
-29.50	0.25	7Y	1.8750	-2.00	1.8950	0.6550	5*7Y	4.50	0.00
-23.00	0.25	10Y	1.9950	-2.00	2.0150	0.6300	5*10Y	16.50	0.00

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	1.7505	0.0292	1.7213	1.7123	1.6834	1.7505	0.5600	1.7505	0.2800
10Y	2.3710	0.0266	2.3444	2.3762	2.3257	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	-35.95	5.12	-41.07	-43.97	-45.06	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-17.40	5.16	-22.56	-19.88	-24.13	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	27.00	0.25	26.75	25.50	25.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	43.50	-0.30	43.80	42.30	43.30	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	62.05	-0.26	62.31	66.39	64.23	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M	61								
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	95.5 / 98								
03Y	4.5 / 4.75 / 5.5	SPRD							
04Y									
05Y	13.5 / 13.75								
07Y									
10Y	22.5 / 23								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS		3Y 4.5							
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			100 건	22	78	127	152	120	67
금 액			32,204 억원	5,996	26,208	39,585	45,789	49,217	21,940

장중동향

국고채 금리, 대외금리 하락에 연동되며 하락 마감.

단기쪽은 기재부가 22일 예정된 국고채 바이백을 계획대로 실시할 것이라고 밝힌 영향으로 수급 부담 우려가 완화되며 되돌림 시도가 이어짐.

IRS, 금투입 앞두고 오퍼가 유입되면서 금리 하락.

오전은 국고채 20년물 입찰(2.560% 낙찰)을 대기하면서 간간히 거래. 전반적으로 2Y,3Y 위주로 호가 대치 활발. 오후 CD가 1bp 높게 고시되었으나 단기를 거래가 많이 되지는 않음.

CRS, 특별히 거래가 많지는 않았으나 금리 하락.