IPS Daily Morning Brief

2017-11-22

종가 기준일 2017-11-21

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6000	0.00	1.6070	1.5724	1.4963	1.6150	1.2875	2.7200	1.2875
9M	1.7025	0.00	1.7135	1.6805	1.5727	1.7250	1.2500	2.7300	1.2500
1Y	1.7875	-0.25	1.8035	1.7729	1.6435	1.8200	1.2200	2.7675	1.2200
1.5Y	1.8800	-0.25	1.8995	1.8815	1.7302	1.9300	1.1900	2.8475	1.1900
2Y	1.9500	-0.50	1.9765	1.9625	1.7942	2.0175	1.1675	2.9225	1.1675
3Y	2.0425	0.00	2.0630	2.0546	1.8789	2.1075	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	2.1000	0.00	2.1185	2.1138	1.9331	2.1600	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	2.1400	0.75	2.1505	2.1478	1.9711	2.1900	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.1800	1.00	2.1870	2.1883	2.0184	2.2300	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.2350	1.00	2.2420	2.2396	2.0852	2.2850	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.2750	1.00	2.2800	2.2708	2.1169	2.3200	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.2800	1.00	2.2850	2.2773	2.1263	2.3275	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.2750	1.00	2.2800	2.2808	2.1350	2.3250	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	10.25	0.00	10.65	10.81	7.64	12.50	-4.50	12.50	-6.00
9*12M	8.50	-0.25	9.00	9.24	7.08	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	16.25	-0.25	17.30	18.96	15.07	20.75	-5.50	20.75	-5.50
2*3Y	9.25	0.50	8.65	9.21	8.47	11.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	15.00	0.50	14.20	15.13	13.89	18.00	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	19.00	1.25	17.40	18.53	17.69	21.25	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	0.00	5.55	5.91	5.42	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	0.75	8.75	9.31	9.22	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.75	3.20	3.40	3.80	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.00	0.25	3.65	4.05	4.73	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	9.50	0.25	9.15	9.19	11.41	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	5.50	0.00	5.50	5.14	6.68	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	3.80	3.11	3.17	4.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.00	4.30	3.77	4.11	5.50	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	0.00	3.80	4.11	4.98	8.75	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.822	0.10	1.822	1.826	1.648	1.885	1.237	2.720	1.237
1.5Y	2.009	0.50	2.014	2.006	1.794	2.037	1.232	2.820	1.232
2Y	2.120	1.00	2.130	2.113	1.889	2.165	1.225	2.920	1.225
3Y	2.160	0.80	2.169	2.156	1.951	2.206	1.200	3.050	1.200
4Y	2.320	1.00	2.327	2.328	2.108	2.360	1.232	3.280	1.232
5Y	2.362	0.50	2.372	2.376	2.160	2.420	1.217	3.410	1.217
7Y	2.492	0.10	2.506	2.502	2.322	2.552	1.270	3.590	1.270
10Y	2.545	0.00	2.560	2.551	2.406	2.607	1.355	3.750	1.355
20Y	2.547	-1.00	2.559	2.515	2.401	2.572	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.47	1.00
CALL	1.23	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	107.95	0.01	107.92	107.97	107.91
LKTB	121.44	0.00	121.34	121.51	121.33

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	-3.45	-0.35	-1.87	-5.34	-0.40	9.00	-17.75	11.00	-17.75
1.5Y	-12.90	-0.75	-11.41	-12.48	-6.38	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-17.00	-1.50	-15.31	-15.06	-9.44	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-11.75	-0.80	-10.58	-10.17	-7.25	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-22.00	-1.00	-20.85	-21.40	-17.46	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-22.20	0.25	-22.19	-22.80	-18.93	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.20	0.90	-31.92	-31.42	-30.37	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.00	1.00	-31.84	-31.09	-32.09	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-27.20	2.00	-27.92	-23.46	-26.64	-14.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-18.75	0.75
-25.00	-0.25
-29.00	-1.00
-32.75	-2.00
-34.50	-2.50
-34.00	-3.75
-33.50	-4.00
-27.50	-4.50

CRS

USD/KRW 1095.80 (-4.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.6000	0.50	1.6200	0.7650	1*2Y	6.00	-2.00
1.5Y	1.6300	-0.50	1.6600	0.8950	2*3Y	5.50	-0.50
2Y	1.6600	-1.50	1.6950	0.7950	2*5Y	14.00	-1.50
3Y	1.7150	-2.00	1.7550	0.7350	3*4Y	4.00	-0.50
4Y	1.7550	-2.50	1.8000	0.6900	3*5Y	8.50	-1.00
5Y	1.8000	-3.00	1.8500	0.6600	4*5Y	4.50	-0.50
7Y	1.8450	-3.00	1.8950	0.6550	5*7Y	4.50	0.00
10Y	1.9600	-3.50	2.0150	0.6300	5*10Y	16.00	-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	1.7797	0.0292	1.7505	1.7213	1.7123	1.7797	0.5600	1.7797	0.2800
10Y	2.3568	-0.0142	2.3710	2.3444	2.3762	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	-34.03	1.92	-35.95	-41.07	-43.97	10.19	-70.50	10.19	-264.00
10Y	-18.82	-1.42	-17.40	-22.56	-19.88	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	28.50	1.50	27.00	26.75	25.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	42.50	-1.00	43.50	43.80	42.30	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	57.71	-4.34	62.05	62.31	66.39	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	70.25		
01Y	78.5 78.75		
1.5Y	87.5 88		
02Y	94.75 95 95.25	SPRD	1*1.5y/9.5
03Y	3.75		2*10y/27.75
04Y			
05Y	12 13.5 13.25 13		
07Y			
10Y	22.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3y/73.5 3y/72 4y/78 5y/82		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	94 건	-6	100	78	127	152	120	67
금 액	33,455 억원	1,251	32,204	26,208	39,585	45,789	49,217	21,940

장중동향

IRS는 채권시장만큼이나 한산한 가운데 단기물 위주로 거래가 집중 됐음. 커브는 스팁.

CRS 금리는 1년 구간을 제외한 전 구간에서 하락. 오퍼가 우위를 보임.