IPS Daily Morning Brief

2017-09-25

종가 기준일 2017-09-22

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4400	-0.25	1.4375	1.4265	1.4222	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4925	-0.25	1.4860	1.4715	1.4685	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5425	-0.25	1.5355	1.5173	1.5124	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.6050	0.00	1.5930	1.5773	1.5749	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6525	-0.25	1.6410	1.6248	1.6236	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7250	-0.25	1.7155	1.7008	1.7029	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7750	-0.25	1.7665	1.7541	1.7574	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8075	-0.25	1.8015	1.7940	1.8016	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8600	-0.50	1.8555	1.8494	1.8614	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9375	-0.50	1.9330	1.9280	1.9470	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9700	-0.50	1.9655	1.9598	1.9776	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9800	-0.50	1.9745	1.9700	1.9857	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9900	-0.50	1.9845	1.9838	2.0005	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	5.25	0.00	4.85	4.50	4.63	5.75	-6.00	5.75	-6.00
9*12M	5.00	0.00	4.95	4.58	4.40	5.25	-4.00	5.25	-4.25
1*2Y	11.00	0.00	10.55	10.75	11.12	12.75	-5.50	16.25	-5.50
2*3Y	7.25	0.00	7.45	7.60	7.93	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.25	0.00	12.55	12.94	13.38	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	15.50	0.00	16.05	16.93	17.80	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	5.10	5.34	5.45	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.25	0.00	8.60	9.33	9.87	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.50	3.99	4.42	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.25	-0.25	5.40	5.54	5.98	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.00	-0.25	13.15	13.40	14.54	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.75	0.00	7.75	7.86	8.56	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.18	3.06	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.15	4.20	3.87	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.00	5.15	5.58	5.35	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.505	0.10	1.506	1.483	1.464	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.632	0.00	1.621	1.606	1.592	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.717	-0.30	1.711	1.696	1.681	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.775	-0.50	1.769	1.760	1.760	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.927	-1.00	1.929	1.895	1.886	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.967	-1.30	1.974	1.967	1.965	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.157	-1.50	2.167	2.152	2.149	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.262	-1.80	2.275	2.265	2.269	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.287	-1.80	2.301	2.313	2.332	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.24	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.01	0.03	109.01	109.04	108.92
LKTB	124.04	0.18	123.95	124.04	123.67

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	3.75	-0.35	2.97	3.46	4.87	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-2.70	0.00	-2.82	-2.86	-1.67	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-6.45	0.05	-6.98	-7.10	-5.71	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.00	0.25	-5.35	-5.94	-5.71	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-15.20	0.75	-16.27	-14.13	-12.84	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-15.95	1.05	-17.27	-17.26	-16.35	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.70	1.00	-31.19	-30.29	-28.75	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-32.45	1.30	-34.20	-33.66	-32.22	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-29.70	1.30	-31.63	-32.88	-33.12	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-55.25	-0.75
-60.00	-1.00
-62.75	-0.75
-64.00	-1.25
-61.50	-1.25
-58.75	-1.25
-58.00	-1.00
-51.75	-1.00

CRS

USD/KRW 1136.50 (+3.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9900	-1.00	1.3800	0.7650	1*2Y	3.50	0.00
1.5Y	1.0050	-1.00	1.2600	0.8100	2*3Y	6.00	-0.50
2Y	1.0250	-1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	19.50	-0.50
3Y	1.0850	-1.50	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00
4Y	1.1600	-1.50	1.3750	0.6900	3*5Y	13.50	0.00
5Y	1.2200	-1.50	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.2800	-1.50	1.4500	0.6550	5*7Y	6.00	0.00
10Y	1.4200	-1.50	1.9050	0.6300	5*10Y	20.00	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	1.4351	-1.16	1.4467	1.4423	1.4052	1.7169	0.5600	1.7169	0.2200
10Y	2.2518	-2.66	2.2784	2.2722	2.2483	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	-0.2819	-0.86	-0.2733	-0.2647	-0.3158	0.1019	-0.7700	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0102	-0.86	-0.0016	-0.0018	-0.0437	0.4740	-0.2446	0.4740	-1.1700

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	28.50	-0.25	28.75	29.50	29.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	54.50	-1.50	56.00	56.70	57.10	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	81.67	-1.50	83.17	82.99	84.31	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	44	ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	60.75		
02Y	64.75 / 65	SPRD	5*9y 11
03Y			
04Y			
05Y	80.5 / 80.75		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	66 건	-30	96	124	98	48	47	66
금 액	18,234 억원	-14,924	33,158	38,800	18,983	13,145	11,980	21,180

장중동향

강세로 출발할 채권은 장 후반 강세를 확대하며
금리 하락 마감. 장기물이 더 강세를 보이며 커브 플랫 마감.

IRS는 비드가 우세한 분위기에 현물대비 약세를 보이며 4년, 5년 거래가 활발. 커브는 소폭 플랫 마감.

CRS는 2년~3년 구간으로 호가가 보이며 전테너 하락 마감.