IPS Daily Morning Brief

2017-09-27

종가 기준일 2017-09-26

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4550	0.50	1.4445	1.4288	1.4235	1.5575	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.5125	1.25	1.4965	1.4739	1.4700	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5700	2.00	1.5480	1.5205	1.5144	1.5700	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.6450	2.75	1.6120	1.5810	1.5771	1.6450	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6975	3.25	1.6615	1.6294	1.6261	1.6975	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7800	4.25	1.7370	1.7058	1.7054	1.7800	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.8275	4.00	1.7870	1.7585	1.7595	1.8275	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8625	4.25	1.8205	1.7975	1.8032	1.8625	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.9100	3.75	1.8730	1.8520	1.8628	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9825	3.50	1.9485	1.9300	1.9479	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0150	3.50	1.9810	1.9620	1.9787	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0275	3.75	1.9915	1.9716	1.9871	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0375	3.75	2.0015	1.9841	2.0020	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	5.75	0.75	5.20	4.51	4.65	5.75	-6.00	5.75	-6.00
9*12M	5.75	0.75	5.15	4.66	4.44	5.75	-4.00	5.75	-4.25
1*2Y	12.75	1.25	11.35	10.89	11.17	12.75	-5.50	16.25	-5.50
2*3Y	8.25	1.00	7.55	7.64	7.93	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.00	0.75	12.55	12.91	13.34	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.50	1.00	15.90	16.81	17.71	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	4.75	-0.25	5.00	5.28	5.41	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.25	0.00	8.35	9.18	9.78	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.25	3.35	3.90	4.37	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.75	-0.50	5.25	5.45	5.96	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	12.00	-0.75	12.80	13.25	14.47	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.25	-0.25	7.55	7.80	8.51	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.20	3.08	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.25	4.30	4.16	3.92	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.50	0.25	5.30	5.41	5.40	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.524	1.50	1.509	1.484	1.466	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.669	2.10	1.640	1.608	1.595	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.765	2.80	1.729	1.701	1.684	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.832	4.20	1.789	1.765	1.763	1.832	1.200	3.120	1.200
4Y	1.985	4.50	1.944	1.904	1.889	1.985	1.232	3.340	1.232
5Y	2.025	4.30	1.986	1.970	1.967	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.210	4.00	2.175	2.157	2.151	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.310	3.80	2.280	2.268	2.271	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.325	3.00	2.302	2.309	2.330	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.25	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.80	-0.16	108.94	108.95	108.78
LKTB	123.52	-0.41	123.85	123.88	123.46

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	4.60	0.50	3.90	3.63	4.83	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-2.40	0.65	-2.82	-2.74	-1.80	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-6.75	0.45	-6.77	-7.11	-5.80	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.20	0.05	-5.24	-5.90	-5.74	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-15.75	-0.50	-15.68	-14.57	-12.96	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-16.25	-0.05	-16.53	-17.26	-16.43	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-30.00	-0.25	-30.22	-30.52	-28.79	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-32.75	-0.30	-33.11	-33.84	-32.27	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-28.75	0.75	-30.09	-32.45	-32.84	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-58.00	-2.00
-65.00	-2.75
-68.75	-3.25
-71.50	-4.25
-68.75	-4.00
-66.25	-4.25
-65.00	-3.75
-58.25	-3.50

CRS

USD/KRW 1136.80 (+5.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9900	0.00	1.3800	0.7650	1*2Y	2.00	0.00
1.5Y	0.9950	0.00	1.2600	0.8100	2*3Y	5.50	0.00
2Y	1.0100	0.00	1.2250	0.7950	2*5Y	19.00	0.00
3Y	1.0650	0.00	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00
4Y	1.1400	0.00	1.3750	0.6900	3*5Y	13.50	0.00
5Y	1.2000	0.00	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.2600	0.00	1.4500	0.6550	5*7Y	6.00	0.00
10Y	1.4000	0.00	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	1.4315	0.44	1.4271	1.4351	1.4467	1.7169	0.5600	1.7169	0.2300
10Y	2.2377	1.77	2.2200	2.2518	2.2784	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	-0.3335	-2.36	-0.3099	-0.2819	-0.2733	0.1019	-0.7700	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0723	-2.03	-0.0520	-0.0102	-0.0016	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	28.25	28.50	28.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	54.50	1.00	53.50	54.50	56.00	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	80.62	1.33	79.29	81.67	83.17	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6y 86.25 / 86.75
06M			9y 95 / 95.5
09M			
01Y	55.5 / 55.75 / 56 / 56.5 / 57		
1.5Y			
02Y	67.5 / 68.25 / 69	SPRD	1*2y 12.5
03Y	75.25 / 75.5 / 76 / 76.5 / 78		1*3y 20 / 20.25
04Y	80.25 / 83		2*3y 08
05Y	83.5		4*5y 3.25
07Y	88.5		6*9y 8.75
10Y	96 / 98.25		10*12y 3.5
12Y	1.75		
15Y			
20Y	1.25		
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	135 건	56	79	66	96	124	98	48
금 액	36,265 억원	14,706	21,559	18,234	33,158	38,800	18,983	13,145

장중동향

금일 채권은 미국채권이 강세였음에도 불구하고 하락출발. 그간 꾸준했던 북한리스크, 국고채 30년물 입찰을 앞둔 경계심 등이 작용. 외인이 10년 비지표물을 매도하고 3년선물을 대량 매도하면서 약세폭을 늘렸고, 커브는 단기부터 중기까지 스팁, 중기부터 장기로갈수록 소폭 플랫 마감.

IRS는 비디시했던 단기쪽에 오퍼가 나오는듯하다가 외인의 채권 매도에 손절성 비드가 줄을 이음.

CRS는 전일비 보합마감.