IPS Daily Morning Brief

2017-10-19

종가 기준일 2017-10-18

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.5000	0.50	1.4855	1.4708	1.4406	1.5275	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.5825	0.50	1.5620	1.5356	1.4923	1.5825	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.6525	0.50	1.6290	1.6011	1.5434	1.6525	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.7400	0.50	1.7175	1.6840	1.6131	1.7400	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.7975	0.00	1.7785	1.7430	1.6653	1.7975	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.8750	0.00	1.8595	1.8265	1.7462	1.8750	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.9250	0.00	1.9120	1.8776	1.7993	1.9250	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.9675	-0.50	1.9575	1.9191	1.8413	1.9725	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.0150	-0.50	2.0080	1.9694	1.8971	2.0250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.0825	-0.50	2.0805	2.0456	1.9784	2.1050	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.1150	-0.50	2.1130	2.0781	2.0103	2.1375	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.1275	-0.50	2.1255	2.0901	2.0212	2.1500	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.1425	-0.25	2.1385	2.0998	2.0358	2.1575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	8.25	0.00	7.65	6.49	5.16	8.25	-5.75	8.25	-6.00
9*12M	7.00	0.00	6.70	6.55	5.12	7.00	-3.50	7.00	-4.25
1*2Y	14.50	-0.50	14.95	14.19	12.19	16.50	-5.50	16.50	-5.50
2*3Y	7.75	0.00	8.10	8.35	8.09	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.75	0.00	13.35	13.46	13.40	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.00	-0.50	17.90	17.61	17.60	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	5.25	5.11	5.31	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.25	-0.50	9.80	9.26	9.51	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	-0.50	4.55	4.15	4.20	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	5.05	5.03	5.58	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	11.50	0.00	12.30	12.65	13.70	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	6.75	0.00	7.25	7.63	8.13	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.25	3.20	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.00	4.50	4.45	4.28	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	6.00	0.25	5.80	5.41	5.74	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.659	0.50	1.641	1.579	1.508	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.767	-0.80	1.764	1.720	1.642	1.775	1.232	2.890	1.232
2Y	1.852	-1.50	1.851	1.806	1.728	1.867	1.225	2.990	1.225
3Y	1.932	-1.40	1.924	1.882	1.806	1.946	1.200	3.120	1.200
4Y	2.087	-1.00	2.081	2.039	1.940	2.101	1.232	3.340	1.232
5Y	2.140	-0.50	2.127	2.079	2.009	2.145	1.217	3.430	1.217
7Y	2.305	-0.50	2.299	2.263	2.191	2.318	1.270	3.590	1.270
10Y	2.392	-0.80	2.393	2.366	2.305	2.418	1.355	3.750	1.355
20Y	2.386	-0.40	2.385	2.363	2.346	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.22	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.53	0.04	108.50	108.56	108.50
LKTB	122.74	0.06	122.73	122.87	122.71

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	-0.65	0.00	-1.24	2.18	3.59	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-2.70	1.30	-4.67	-3.58	-2.93	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-5.45	1.50	-7.27	-6.30	-6.25	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.70	1.40	-6.45	-5.60	-5.95	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-16.20	1.00	-16.92	-16.10	-14.07	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-17.25	0.00	-16.95	-15.99	-16.76	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.00	0.00	-29.14	-29.40	-29.36	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-30.95	0.30	-31.29	-32.00	-32.67	-12.95	-38.70	-6.25	-38.70
20Y	-24.35	0.15	-24.63	-26.29	-31.07	-16.45	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-54.25	0.00
-58.50	0.00
-60.75	-0.50
-59.50	-0.50
-55.00	-0.50
-51.25	0.00
-45.00	1.00
-35.75	1.00

CRS

USD/KRW 1129.90 (-2.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1100	0.50	1.3300	0.7650	1*2Y	8.00	-1.00
1.5Y	1.1550	0.50	1.1750	0.8100	2*3Y	9.00	0.00
2Y	1.1900	-0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	26.50	0.00
3Y	1.2800	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	9.50	0.00
4Y	1.3750	-0.50	1.3800	0.6900	3*5Y	17.50	0.00
5Y	1.4550	-0.50	1.4600	0.6600	4*5Y	8.00	0.00
7Y	1.5650	0.50	1.5650	0.6550	5*7Y	11.00	1.00
10Y	1.7250	0.50	1.7250	0.6300	5*10Y	27.00	1.00

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	1.5711	2.89	1.5422	1.5379	1.4970	1.7169	0.5600	1.7169	0.2600
10Y	2.3441	4.39	2.3002	2.3046	2.2778	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	-0.2809	4.39	-0.3248	-0.3221	-0.3450	0.1019	-0.7050	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0479	5.19	-0.0998	-0.1004	-0.1122	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	-0.50	29.00	30.25	31.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	54.00	0.70	53.30	54.50	54.80	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	77.30	1.50	75.80	76.67	78.08	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6Y 99
06M			
09M	57.75 / 58		
01Y			
1.5Y	72.25 / 72.75 / 73		
02Y	78.5	SPRD	6M*1Y 15.25
03Y			6M*1.5Y 23.75
04Y			1*2Y 14.5
05Y			1*3Y 22.25
07Y			2*3Y 7.5 / 7.75
10Y			2*4Y 12.75
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1Y 10		

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	110 건	-34	144	50	106	143	122	85
금 액	33,290 억원	-21,025	54,315	20,020	34,760	37,780	39,535	30,060

장중동향

국고채 금리, 그동안 금통위 불확실성 반영으로 금리 올랐으나 금일 저가 매수가 유입되면서 전구간 금리 하락 마감.

IRS, 금통위를 하루 앞둔 영향으로 금리 인상 우려에 혼조세.
단기물 위주로 비디쉬 한 분위기가 형성되면서 1.5Y까지 금리가 상승, 2-4Y 구간 보합, 5Y 이상 구간 금리 하락.

CRS, 금리 혼조 마감. 장기 중심으로 금리 상승. 조용한 분위기.
기아자동차와 주택금융공사의 대규모 외화채 발행을 앞두고 CRS 금리 상승이 이어지자 부채 스왑 물량이 줄어들 가능성이 제기되면서 규모와 금리 방향에 대해 갑론을박.