IPS Daily Morning Brief

2017-09-04

종가 기준일 2017-09-01

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4250	0.50	1.4240	1.4321	1.4169	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4675	0.50	1.4710	1.4803	1.4610	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5125	0.50	1.5165	1.5253	1.5032	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5775	0.50	1.5820	1.5930	1.5644	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6250	0.25	1.6275	1.6418	1.6090	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7025	0.50	1.7025	1.7243	1.6837	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7600	0.50	1.7585	1.7794	1.7358	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8050	0.50	1.8020	1.8224	1.7790	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8675	0.75	1.8620	1.8829	1.8379	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9450	0.50	1.9410	1.9681	1.9238	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9750	0.50	1.9710	1.9991	1.9544	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9875	0.50	1.9865	2.0125	1.9613	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0075	0.50	2.0070	2.0341	1.9739	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	4.25	0.00	4.70	4.81	4.42	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.50	0.00	4.55	4.50	4.21	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	11.25	-0.25	11.10	11.65	10.58	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.75	0.25	7.50	8.25	7.47	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.50	0.25	13.10	13.76	12.68	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.00	0.25	17.45	18.06	17.01	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	0.00	5.60	5.51	5.21	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.00	9.95	9.81	9.54	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.35	4.30	4.33	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.25	0.25	6.00	6.05	5.89	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	14.00	0.00	13.90	14.58	14.48	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.75	-0.25	7.90	8.53	8.59	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	3.10	3.06	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.55	4.44	3.75	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	6.25	0.00	6.60	6.60	5.01	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.458	-1.40	1.484	1.489	1.454	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.587	-1.30	1.613	1.632	1.582	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.677	-0.30	1.690	1.705	1.663	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.747	0.00	1.755	1.787	1.741	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.865	0.00	1.868	1.900	1.860	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.967	0.00	1.966	1.993	1.941	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.155	0.60	2.145	2.171	2.124	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.277	1.00	2.260	2.293	2.242	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.340	0.00	2.342	2.368	2.318	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.24	0.01

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.29	0.01	109.30	109.33	109.25
LKTB	214.20	89.90	124.32	124.37	124.17

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	5.45	1.90	3.29	3.63	4.94	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-0.95	1.80	-3.08	-3.87	-1.74	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-5.20	0.55	-6.27	-6.31	-5.41	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-4.45	0.50	-5.23	-6.27	-5.77	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-10.50	0.50	-10.99	-12.04	-12.46	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-16.20	0.50	-16.42	-17.04	-16.17	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-28.75	0.15	-28.26	-28.77	-28.57	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-33.20	-0.50	-31.88	-32.49	-31.80	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-33.25	0.50	-33.54	-33.37	-34.40	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-61.25	-1.00
-64.75	-1.00
-66.00	-0.75
-63.75	-1.00
-59.00	-1.00
-56.00	-1.50
-52.25	-2.75
-46.50	-2.50

CRS

USD/KRW 1120.50 (-7.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9000	-0.50	1.3900	0.7650	1*2Y	6.50	0.00
1.5Y	0.9300	-0.50	1.2600	0.8100	2*3Y	10.00	0.00
2Y	0.9650	-0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	28.00	-0.50
3Y	1.0650	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	10.50	0.00
4Y	1.1700	-0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	18.00	-0.50
5Y	1.2450	-1.00	1.4350	0.6600	4*5Y	7.50	-0.50
7Y	1.3450	-2.00	1.4500	0.6550	5*7Y	10.00	-1.00
10Y	1.4800	-2.00	1.9050	0.6300	5*10Y	23.50	-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	1.3460	1.65	1.3295	1.3294	1.3174	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1674	4.87	2.1187	2.1336	2.1362	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	-0.3310	1.95	-0.3505	-0.3576	-0.3896	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.1096	3.87	-0.1483	-0.1164	-0.1188	0.4740	-0.1483	0.4740	-1.1900

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	32.00	0.25	31.75	31.00	31.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	60.00	1.30	58.70	56.30	54.80	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	82.14	3.22	78.92	80.42	81.88	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	46.25		
01Y	50.75		
1.5Y			
02Y	62	SPRD	
03Y			
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	95		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	49 건	-21	70	108	98	47	102	87
금 액	19,640 억원	-10,273	29,913	32,995	27,140	8,140	28,568	24,464

장중동향

IRS는 오늘 미국 비농업부문 고용지표 발표를 앞둔 데다 주말이라 조용한 편이었음. 10년 국채선물이 장 막판 약간 밀리면서 커브가 스팁 됐는데, IRS도 이에 영향을 받은 것 같아보임.

CRS는 오늘 빠지긴 했지만, 거래가 있었던 것 같지는 않아 보임. 그동안 너무 상승한 데 따른 되돌림 같음.