

IPS Daily Morning Brief

2017-09-05

종가 기준일 2017-09-04

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4300	0.50	1.4230	1.4326	1.4174	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4725	0.50	1.4680	1.4808	1.4617	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5175	0.50	1.5135	1.5260	1.5040	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5875	1.00	1.5800	1.5939	1.5656	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6400	1.50	1.6280	1.6426	1.6105	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7200	1.75	1.7045	1.7249	1.6854	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7800	2.00	1.7615	1.7801	1.7378	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8250	2.00	1.8055	1.8231	1.7810	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8875	2.00	1.8665	1.8833	1.8398	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9675	2.25	1.9455	1.9680	1.9254	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9975	2.25	1.9755	1.9989	1.9558	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0100	2.25	1.9900	2.0125	1.9628	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0275	2.00	2.0090	2.0341	1.9756	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.25	0.00	4.50	4.81	4.43	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.50	0.00	4.55	4.53	4.23	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	12.25	1.00	11.45	11.66	10.64	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	0.25	7.65	8.23	7.50	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.00	0.50	13.35	13.75	12.73	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.50	0.50	17.75	18.05	17.06	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	6.00	0.25	5.70	5.53	5.23	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.50	0.25	10.10	9.83	9.56	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.40	4.30	4.33	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.25	0.00	6.10	6.01	5.87	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	14.25	0.25	14.00	14.49	14.43	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	0.25	7.90	8.48	8.56	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	3.09	3.05	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.45	4.45	3.75	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	6.00	-0.25	6.35	6.61	5.02	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	0.00	1.476	1.491	1.454	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.596	0.90	1.606	1.633	1.582	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.708	3.10	1.692	1.707	1.665	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.777	3.00	1.758	1.787	1.743	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.895	3.00	1.873	1.900	1.862	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.997	3.00	1.973	1.994	1.942	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.182	2.70	2.154	2.172	2.125	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.302	2.50	2.270	2.294	2.243	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.377	3.70	2.348	2.368	2.319	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.25	0.01

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.19	-0.10	109.17	109.25	109.15
LKTB	123.87	-0.33	123.77	124.00	123.71

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	5.95	0.50	3.77	3.49	5.00	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-0.85	0.10	-2.60	-3.94	-1.68	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-6.80	-1.60	-6.38	-6.43	-5.41	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.70	-1.25	-5.37	-6.21	-5.73	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.50	-1.00	-11.19	-11.99	-12.38	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-17.20	-1.00	-16.77	-17.05	-16.12	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.45	-0.70	-28.73	-28.84	-28.52	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-33.45	-0.25	-32.47	-32.55	-31.79	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-34.95	-1.70	-33.88	-33.38	-34.32	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1131.50 (+11.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-62.25	-1.00	1Y	0.8950	-0.50	1.3900	0.7650	1*2Y	5.50	-1.00	
-66.25	-1.50	1.5Y	0.9250	-0.50	1.2600	0.8100	2*3Y	10.00	0.00	
-69.00	-3.00	2Y	0.9500	-1.50	1.2250	0.7950	2*5Y	27.00	-1.00	
-67.00	-3.25	3Y	1.0500	-1.50	1.3150	0.7350	3*4Y	10.00	-0.50	
-63.00	-4.00	4Y	1.1500	-2.00	1.3750	0.6900	3*5Y	17.00	-1.00	
-60.50	-4.50	5Y	1.2200	-2.50	1.4350	0.6600	4*5Y	7.00	-0.50	
-56.75	-4.50	7Y	1.3200	-2.50	1.4500	0.6550	5*7Y	10.00	0.00	
-51.25	-4.75	10Y	1.4550	-2.50	1.9050	0.6300	5*10Y	23.50	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	1.3460	0	1.3460	1.3295	1.3294	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1674	0.00	2.1674	2.1187	2.1336	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	-0.3620	-3.1	-0.3310	-0.3505	-0.3576	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.1346	-2.50	-0.1096	-0.1483	-0.1164	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	32.75	0.75	32.00	31.75	31.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	59.40	-0.60	60.00	58.70	56.30	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	82.14	0.00	82.14	78.92	80.42	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	9y / 94.25						
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	65	SPRD	12*20/03						
03Y									
04Y									
05Y									
07Y									
10Y	96.5								
12Y	2								
15Y									
20Y	2.03								
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	57 건	8	49	70	108	98	47	102	
금 액	14,207 억원	-5,433	19,640	29,913	32,995	27,140	8,140	28,568	

장중동향
IRS는 상승 마감. 북한 핵실험 이후 외국인 흐름에 주목하면서 국채선물 움직임에 연동됨.

CRS 금리는 전 구간에 걸쳐 하락. 북한 핵실험 영향과 미국 노동절 휴장 등으로 스와프 시장은 조용한 편이었음.