

IPS Daily Morning Brief

2017-09-06

종가 기준일 2017-09-05

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4275	-0.25	1.4235	1.4320	1.4179	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4700	-0.25	1.4665	1.4801	1.4625	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5150	-0.25	1.5120	1.5255	1.5050	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5825	-0.50	1.5785	1.5934	1.5670	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6350	-0.50	1.6285	1.6421	1.6121	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7150	-0.50	1.7060	1.7239	1.6874	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7775	-0.25	1.7645	1.7794	1.7400	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8225	-0.25	1.8090	1.8224	1.7833	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8850	-0.25	1.8705	1.8823	1.8421	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9625	-0.50	1.9490	1.9665	1.9275	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9950	-0.25	1.9795	1.9974	1.9579	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0050	-0.50	1.9925	2.0111	1.9650	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0200	-0.75	2.0105	2.0326	1.9778	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.25	0.00	4.30	4.81	4.45	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.50	0.00	4.55	4.54	4.25	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	12.00	-0.25	11.65	11.66	10.71	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	0.00	7.75	8.18	7.53	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.25	0.25	13.60	13.73	12.78	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.75	0.25	18.05	18.03	17.12	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	6.25	0.25	5.85	5.55	5.25	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.75	0.25	10.30	9.85	9.59	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.45	4.30	4.34	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.25	0.00	6.15	5.99	5.88	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	14.00	-0.25	14.00	14.41	14.42	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.75	-0.25	7.85	8.43	8.54	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.25	3.05	3.09	3.04	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.35	4.46	3.75	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.75	-0.25	6.15	6.61	5.03	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.451	-0.70	1.465	1.492	1.454	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.585	-1.10	1.596	1.633	1.583	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.705	-0.30	1.691	1.708	1.666	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.777	0.00	1.760	1.786	1.745	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.892	-0.30	1.876	1.899	1.863	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.995	-0.20	1.977	1.993	1.944	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.182	0.00	2.161	2.172	2.127	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.305	0.30	2.280	2.293	2.245	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.365	-1.20	2.351	2.367	2.320	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	109.22	0.03	109.22	109.25	109.18
LKTb	123.92	0.05	123.87	123.98	123.75

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	6.40	0.45	4.68	3.36	5.07	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-0.25	0.60	-1.75	-3.99	-1.61	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-7.00	-0.20	-6.29	-6.57	-5.42	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-6.20	-0.50	-5.36	-6.19	-5.74	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.45	0.05	-11.13	-11.95	-12.33	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-17.25	-0.05	-16.82	-17.09	-16.12	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.70	-0.25	-29.05	-28.96	-28.50	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-34.25	-0.80	-33.12	-32.69	-31.80	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-34.50	0.45	-34.09	-33.46	-34.25	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1131.00 (-0.50)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-61.50	0.75	1Y	0.9000	0.50	1.3900	0.7650	1*2Y	4.50	-1.00
-66.75	-0.50	1.5Y	0.9150	-1.00	1.2600	0.8100	2*3Y	9.50	-0.50
-69.00	0.00	2Y	0.9450	-0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	27.00	0.00
-67.50	-0.50	3Y	1.0400	-1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	10.00	0.00
-63.75	-0.75	4Y	1.1400	-1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	17.50	0.50
-60.75	-0.25	5Y	1.2150	-0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	7.50	0.50
-57.50	-0.75	7Y	1.3100	-1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	9.50	-0.50
-51.75	-0.50	10Y	1.4450	-1.00	1.9050	0.6300	5*10Y	23.00	-0.50

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	1.2860	-6.00	1.3460	1.3460	1.3295	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.0604	-10.70	2.1674	2.1674	2.1187	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	-0.4190	-5.7	-0.3620	-0.3310	-0.3505	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.2446	-11.00	-0.1346	-0.1096	-0.1483	0.4740	-0.2446	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	0.00	32.75	32.00	31.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	60.00	0.60	59.40	60.00	58.70	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	77.44	-4.70	82.14	82.14	78.92	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	43									
09M	47.25									
01Y	52									
1.5Y	58.5									
02Y					SPRD	9*12m/4.75				
03Y	71.75	72				5*10y/14				
04Y										
05Y	82.25									
07Y										
10Y	96.25									
12Y										
15Y	0.5									
20Y										
CRS	9y/42									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			62 건	5	57	49	70	108	98	47
금 액			17,644 억원	3,437	14,207	19,640	29,913	32,995	27,140	8,140

장중동향
IRS는 장중 큰 움직임은 없다가 장 막판에 북한 관련 이벤트가 끝나간다고 생각했는지 오퍼가 조금씩 나오면서 강보합으로 마감.

CRS 금리는 1년을 제외하고 전 구간에 걸쳐 하락.특별한 물량이 나오진 않았고 장기 쪽에서 오퍼가 조금 나온듯함.