IPS Daily Morning Brief

2017-09-07

종가 기준일 2017-09-06

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4250	-0.25	1.4255	1.4310	1.4183	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4675	-0.25	1.4680	1.4786	1.4630	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5125	-0.25	1.5130	1.5239	1.5058	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5775	-0.50	1.5795	1.5915	1.5681	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6300	-0.50	1.6305	1.6401	1.6136	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7050	-1.00	1.7080	1.7211	1.6891	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7625	-1.50	1.7670	1.7769	1.7419	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8075	-1.50	1.8120	1.8198	1.7854	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8675	-1.75	1.8735	1.8795	1.8443	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9450	-1.75	1.9520	1.9633	1.9295	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9775	-1.75	1.9830	1.9941	1.9599	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9875	-1.75	1.9945	2.0080	1.9670	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0000	-2.00	2.0115	2.0291	1.9800	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	4.25	0.00	4.25	4.76	4.47	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.50	0.00	4.50	4.53	4.28	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	11.75	-0.25	11.75	11.63	10.78	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.50	-0.50	7.75	8.10	7.55	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.25	-1.00	13.65	13.68	12.83	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.75	-1.00	18.15	17.96	17.18	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	-0.50	5.90	5.58	5.28	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	-0.50	10.40	9.86	9.63	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.50	4.29	4.35	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.00	-0.25	6.15	5.98	5.89	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.75	-0.25	14.00	14.35	14.42	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.75	0.00	7.85	8.38	8.53	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.10	3.09	3.04	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.25	4.48	3.75	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.50	-0.25	5.95	6.59	5.04	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.452	0.10	1.458	1.491	1.455	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.585	0.00	1.591	1.631	1.583	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.699	-0.60	1.694	1.707	1.668	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.777	0.00	1.765	1.783	1.746	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.885	-0.70	1.880	1.896	1.865	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.984	-1.10	1.982	1.991	1.946	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.162	-2.00	2.166	2.170	2.129	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.280	-2.50	2.286	2.291	2.247	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.332	-3.30	2.351	2.364	2.321	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	109.24	0.02	109.28	109.29	109.23
LKTB	124.15	0.23	124.20	124.29	124.13

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	6.05	-0.35	5.48	3.30	5.11	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-0.75	-0.50	-1.11	-3.98	-1.54	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-6.90	0.10	-6.33	-6.72	-5.42	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-7.20	-1.00	-5.70	-6.19	-5.72	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.25	-0.80	-11.34	-11.91	-12.29	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-17.65	-0.40	-17.00	-17.11	-16.10	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.45	0.25	-29.25	-29.01	-28.47	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-33.50	0.75	-33.42	-32.76	-31.79	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-33.20	1.30	-33.93	-33.44	-34.14	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-61.25	0.25
-66.25	0.50
-70.00	-1.00
-69.50	-2.00
-66.25	-2.50
-63.25	-2.50
-59.75	-2.25
-54.00	-2.25

CRS

USD/KRW 1135.40 (+4.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9000	0.00	1.3900	0.7650	1*2Y	3.00	-1.50
1.5Y	0.9150	0.00	1.2600	0.8100	2*3Y	8.00	-1.50
2Y	0.9300	-1.50	1.2250	0.7950	2*5Y	24.50	-2.50
3Y	1.0100	-3.00	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	-1.00
4Y	1.1000	-4.00	1.3750	0.6900	3*5Y	16.50	-1.00
5Y	1.1750	-4.00	1.4350	0.6600	4*5Y	7.50	0.00
7Y	1.2700	-4.00	1.4500	0.6550	5*7Y	9.50	0.00
10Y	1.4050	-4.00	1.9050	0.6300	5*10Y	23.00	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	1.3181	3.21	1.2860	1.3460	1.3460	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1055	4.51	2.0604	2.1674	2.1674	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	-0.3809	3.81	-0.4190	-0.3620	-0.3310	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.1745	7.01	-0.2446	-0.1346	-0.1096	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	31.50	-1.25	32.75	32.75	32.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	58.10	-1.90	60.00	59.40	60.00	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	78.74	1.30	77.44	82.14	82.14	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	9Y 92.25
06M	42.25		
09M			
01Y			
1.5Y	57.25	SPRD	
02Y	62.25 / 62.5		
03Y	70 / 70.25		
04Y			
05Y	80.25 / 80.5		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	88 건	26	62	57	49	70	108	98
금 액	25,560 억원	7,916	17,644	14,207	19,640	29,913	32,995	27,140

장중동향

국고채 금리, 미 금리 하락과 외인 국채선물 순매수가 강세를 주도하면서 금리 하락.

IRS, 장기구간을 중심으로 금리가 하락하면서 커브 플래트닝.
국채선물이 소폭 상승하면서 장중 오퍼리시해져 금리 하락, 막판 국채선물이 소폭 밀리면서 금리 일부 되돌림.
미국 금리가 간밤 크게 빠졌지만 IRS는 일부 반영하는데 그치는 정도.

CRS, 1-1.5년을 제외한 전구간에서 금리 하락.