

IPS Daily Morning Brief

2017-09-11

종가 기준일 2017-09-08

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4125	-1.00	1.4235	1.4299	1.4188	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4550	-1.00	1.4660	1.4774	1.4638	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5000	-1.00	1.5110	1.5225	1.5069	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5550	-1.50	1.5745	1.5888	1.5696	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6050	-1.50	1.6260	1.6373	1.6157	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6825	-1.75	1.7045	1.7174	1.6920	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7300	-2.50	1.7610	1.7730	1.7452	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7700	-2.75	1.8045	1.8159	1.7890	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8200	-3.00	1.8620	1.8748	1.8480	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9000	-3.25	1.9415	1.9576	1.9333	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9325	-3.25	1.9735	1.9888	1.9636	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9400	-3.50	1.9835	2.0024	1.9707	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9525	-3.50	1.9975	2.0226	1.9840	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.25	0.00	4.25	4.75	4.50	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.50	0.00	4.50	4.51	4.30	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	10.50	-0.50	11.50	11.48	10.88	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.75	-0.25	7.85	8.01	7.63	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.50	-1.00	13.50	13.58	12.95	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.50	-1.25	17.85	17.86	17.33	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	4.75	-0.75	5.65	5.56	5.32	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.75	-1.00	10.00	9.85	9.70	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	-0.25	4.35	4.29	4.38	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.00	-0.25	5.75	5.89	5.90	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.00	-0.50	13.70	14.18	14.44	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	-0.25	7.95	8.29	8.53	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.20	3.11	3.03	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	-0.25	4.20	4.48	3.73	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	-0.25	5.60	6.50	5.07	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.463	0.00	1.457	1.489	1.456	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.595	0.00	1.591	1.627	1.584	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.687	-1.40	1.700	1.707	1.670	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.752	-2.50	1.772	1.779	1.749	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.857	-2.50	1.882	1.891	1.867	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.940	-3.20	1.978	1.986	1.950	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.120	-3.10	2.159	2.165	2.132	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.235	-3.20	2.278	2.285	2.251	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.286	-2.40	2.334	2.356	2.323	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.23	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.33	0.08	109.29	109.34	109.28
LKTB	124.65	0.36	124.51	124.74	124.48

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	3.70	-1.00	5.36	3.40	5.13	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-4.00	-1.50	-1.67	-3.82	-1.49	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-8.20	-0.10	-7.40	-6.98	-5.46	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-6.95	0.75	-6.75	-6.15	-5.69	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.70	0.00	-12.12	-11.81	-12.22	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-17.00	0.45	-17.31	-16.98	-16.06	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-30.00	0.10	-29.74	-29.04	-28.42	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-33.50	-0.05	-33.63	-32.78	-31.77	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-33.35	-1.10	-33.65	-33.33	-33.94	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1127.55 (-1.85)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRW	Lv.	전일비
-61.00	-1.50	1Y	0.8900	-2.50	1.3800	0.7650	1*2Y	3.00	0.00
-65.00	-1.00	1.5Y	0.9050	-2.50	1.2600	0.8100	2*3Y	6.50	0.00
-68.50	-1.00	2Y	0.9200	-2.50	1.2250	0.7950	2*5Y	21.50	-1.00
-69.75	-0.75	3Y	0.9850	-2.50	1.3150	0.7350	3*4Y	8.50	-0.50
-66.00	-0.50	4Y	1.0700	-3.00	1.3750	0.6900	3*5Y	15.00	-1.00
-63.50	-0.75	5Y	1.1350	-3.50	1.4350	0.6600	4*5Y	6.50	-0.50
-60.50	-1.00	7Y	1.2150	-4.00	1.4500	0.6550	5*7Y	8.00	-0.50
-55.00	-0.75	10Y	1.3500	-4.00	1.9050	0.6300	5*10Y	21.50	-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	1.2620	-0.40	1.2660	1.3181	1.2860	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.0524	1.37	2.0387	2.1055	2.0604	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	-0.4250	1	-0.4350	-0.3809	-0.4190	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.1826	4.57	-0.2283	-0.1745	-0.2446	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	29.50	-1.75	31.25	31.50	32.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	54.80	-1.80	56.60	58.10	60.00	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	79.04	1.77	77.27	78.74	77.44	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	41.25 / 41.75								
09M	46								
01Y	50								
1.5Y									
02Y	60.25 / 60.5 / 60.75				SPRD	6*9m	4.25		
03Y	67.5 / 67.75					1*2y	10.5		
04Y						1*3y	17.5 / 17.75		
05Y	77.25								
07Y									
10Y	90								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y 90.5								
	4y 8.5								
	5y 13.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	108 건	45	63	88	62	57	49	70	
금 액	32,376 억원	17,161	15,215	25,560	17,644	14,207	19,640	29,913	

장종동향

채권은 ECB의 비둘기적 스탠스와 북한리스크 대기로 금리 하락. 특히 5년과 10년이 상대적으로 강세.

IRS는 장시작부터 아웃라잇이 오퍼리시한 모습을 보이며 하락. 3년과 5년쪽 오퍼가 강했고, 단기쪽은 비드가 받쳐주며 하락폭을 줄임. 커브 플랫마감.

CRS는 최근 상승분을 되돌리며 전구간 하락.