IPS Daily Morning Brief

2017-09-12

종가 기준일 2017-09-11

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4150	0.25	1.4205	1.4290	1.4189	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4575	0.25	1.4630	1.4765	1.4641	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5025	0.25	1.5080	1.5216	1.5073	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5575	0.25	1.5685	1.5873	1.5702	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6100	0.50	1.6200	1.6360	1.6167	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6900	0.75	1.6985	1.7158	1.6933	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7400	1.00	1.7530	1.7711	1.7467	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7800	1.00	1.7955	1.8141	1.7905	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8300	1.00	1.8505	1.8726	1.8496	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9100	1.00	1.9300	1.9550	1.9349	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9425	1.00	1.9625	1.9863	1.9652	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9500	1.00	1.9715	1.9996	1.9721	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9625	1.00	1.9845	2.0194	1.9857	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	4.25	0.00	4.25	4.75	4.52	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.50	0.00	4.50	4.51	4.31	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	10.75	0.25	11.20	11.44	10.94	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	0.25	7.85	7.98	7.67	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.00	0.50	13.30	13.51	13.00	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.00	0.50	17.55	17.81	17.39	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.25	5.45	5.54	5.34	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.00	0.25	9.70	9.84	9.72	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.00	4.25	4.30	4.38	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.00	0.00	5.50	5.85	5.90	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.00	0.00	13.45	14.09	14.44	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	0.00	7.95	8.24	8.53	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.13	3.03	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.15	4.46	3.72	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.00	5.45	6.44	5.08	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.469	0.60	1.460	1.487	1.456	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.599	0.40	1.592	1.624	1.585	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.690	0.30	1.696	1.706	1.672	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.757	0.50	1.768	1.776	1.750	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.907	5.00	1.885	1.891	1.869	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.955	1.50	1.969	1.983	1.951	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.141	2.10	2.151	2.163	2.134	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.252	1.70	2.268	2.283	2.253	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.280	-0.60	2.315	2.352	2.324	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.25	0.02

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.31	-0.02	109.30	109.30	109.30
LKTB	124.46	-0.19	124.52	124.58	124.46

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	3.35	-0.35	4.84	3.48	5.10	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-4.15	-0.15	-2.33	-3.68	-1.49	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-8.00	0.20	-7.64	-6.95	-5.49	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-6.70	0.25	-6.95	-6.06	-5.68	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-16.70	-4.00	-13.16	-11.96	-12.27	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-17.50	-0.50	-17.37	-16.92	-16.07	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.10	-1.10	-30.07	-29.07	-28.41	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-34.20	-0.70	-33.78	-32.79	-31.78	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-31.75	1.60	-33.01	-33.28	-33.82	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-58.25	2.75
-63.25	1.75
-68.00	0.50
-70.50	-0.75
-67.00	-1.00
-63.50	0.00
-60.50	0.00
-55.00	0.00

CRS

USD/KRW 1131.80 (+4.25)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9200	3.00	1.3800	0.7650	1*2Y	1.00	-2.00
1.5Y	0.9250	2.00	1.2600	0.8100	2*3Y	5.50	-1.00
2Y	0.9300	1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	21.50	0.00
3Y	0.9850	0.00	1.3150	0.7350	3*4Y	8.50	0.00
4Y	1.0700	0.00	1.3750	0.6900	3*5Y	16.00	1.00
5Y	1.1450	1.00	1.4350	0.6600	4*5Y	7.50	1.00
7Y	1.2250	1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	8.00	0.00
10Y	1.3600	1.00	1.9050	0.6300	5*10Y	21.50	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	1.3186	5.66	1.2620	1.2660	1.3181	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1323	7.99	2.0524	2.0387	2.1055	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	-0.3714	5.36	-0.4250	-0.4350	-0.3809	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.1197	6.29	-0.1826	-0.2283	-0.1745	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	30.00	0.50	29.50	31.25	31.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	56.20	1.40	54.80	56.60	58.10	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	81.37	2.33	79.04	77.27	78.74	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6y 79.75
06M			
09M			
01Y	50.25		
1.5Y			
02Y	60.75 / 61	SPRD	5*10y 13
03Y			7*9y 6.25
04Y	73.75		7*10y 8.25
05Y	78		
07Y			
10Y	91.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y 92 4y 07		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	45 건	-63	108	63	88	62	57	49
금 액	13,905 억원	-18,471	32,376	15,215	25,560	17,644	14,207	19,640

장중동향

채권은 대부분 구간에서 상승하고 20년물이 소폭하락. 외국인의 국채선물 매수가 금리약세폭을 줄임.

IRS는 미국금리 영향으로 소폭 상승했고 커브 스티프닝 마감. 장 초반에는 오퍼가 우위를 보였으나 비드가 없어 거래가 주춤했고 오후들어서는 장기쪽 비드가 나오면서 스프레드 비드가 눈에 띔.

CRS는 3년,4년을 제외하고 전구간 상승 마감.