IPS Daily Morning Brief

2017-09-13

종가 기준일 2017-09-12

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4200	0.50	1.4190	1.4284	1.4191	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4625	0.50	1.4615	1.4759	1.4645	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5025	0.00	1.5055	1.5208	1.5076	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5575	0.00	1.5635	1.5858	1.5707	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6050	-0.50	1.6140	1.6345	1.6175	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6825	-0.75	1.6920	1.7138	1.6945	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7325	-0.75	1.7440	1.7689	1.7480	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7675	-1.25	1.7845	1.8118	1.7918	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8175	-1.25	1.8370	1.8699	1.8508	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8925	-1.75	1.9160	1.9515	1.9361	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9250	-1.75	1.9485	1.9829	1.9663	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9300	-2.00	1.9565	1.9959	1.9733	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9400	-2.25	1.9685	2.0150	1.9871	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	4.25	0.00	4.25	4.75	4.54	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.00	-0.50	4.40	4.49	4.31	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	10.25	-0.50	10.85	11.38	10.98	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.75	-0.25	7.80	7.93	7.70	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.75	-0.25	13.00	13.44	13.05	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.25	-0.75	17.05	17.73	17.44	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	5.20	5.51	5.35	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.50	-0.50	9.25	9.80	9.74	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	-0.50	4.05	4.29	4.38	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.00	0.00	5.25	5.81	5.90	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	12.50	-0.50	13.15	13.98	14.43	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.50	-0.50	7.90	8.16	8.53	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.14	3.03	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	-0.25	4.05	4.44	3.73	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.75	-0.50	5.25	6.35	5.10	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.478	0.90	1.465	1.486	1.457	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.599	0.00	1.595	1.621	1.586	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.685	-0.50	1.692	1.704	1.673	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.752	-0.50	1.763	1.774	1.751	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.905	-0.20	1.887	1.890	1.871	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.952	-0.30	1.961	1.981	1.953	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.139	-0.20	2.143	2.161	2.135	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.247	-0.50	2.256	2.280	2.254	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.275	-0.50	2.297	2.348	2.325	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.24	-0.01

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.33	0.02	109.28	109.33	109.28
LKTB	124.53	0.07	124.30	124.55	124.29

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	2.45	-0.90	4.05	3.52	5.06	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-4.15	0.00	-3.11	-3.54	-1.50	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-8.00	0.00	-7.84	-6.93	-5.52	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-6.95	-0.25	-7.10	-5.99	-5.69	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-17.25	-0.55	-14.32	-12.13	-12.35	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-18.45	-0.95	-17.61	-16.91	-16.12	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.15	-1.05	-30.56	-29.15	-28.45	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-35.45	-1.25	-34.02	-32.87	-31.84	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-33.50	-1.75	-32.81	-33.32	-33.74	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-56.75	1.50
-61.75	1.50
-65.50	2.50
-67.25	3.25
-63.75	3.25
-60.25	3.25
-58.25	2.25
-51.75	3.25

CRS

USD/KRW 1128.50 (-3.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9350	1.50	1.3800	0.7650	1*2Y	1.50	0.50
1.5Y	0.9400	1.50	1.2600	0.8100	2*3Y	6.00	0.50
2Y	0.9500	2.00	1.2250	0.7950	2*5Y	21.50	0.00
3Y	1.0100	2.50	1.3150	0.7350	3*4Y	8.50	0.00
4Y	1.0950	2.50	1.3750	0.6900	3*5Y	15.50	-0.50
5Y	1.1650	2.00	1.4350	0.6600	4*5Y	7.00	-0.50
7Y	1.2350	1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	7.00	-1.00
10Y	1.3750	1.50	1.9050	0.6300	5*10Y	21.00	-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	1.3348	1.62	1.3186	1.2620	1.2660	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1690	3.67	2.1323	2.0524	2.0387	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	-0.3502	2.12	-0.3714	-0.4250	-0.4350	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0780	4.17	-0.1197	-0.1826	-0.2283	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	28.75	-1.25	30.00	29.50	31.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	56.20	0.00	56.20	54.80	56.60	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	83.42	2.05	81.37	79.04	77.27	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	50.25		
1.5Y			
02Y	60.5 60.75	SPRD	2*3y/7.75
03Y	68.5 68.75 69.25		3*4y/05
04Y	73.5		3*5y/09
05Y	78 78.25		20*25y/00
07Y			
10Y	89.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	92 건	47	45	108	63	88	62	57
금 액	24,750 억원	10,845	13,905	32,376	15,215	25,560	17,644	14,207

장중동향

IRS 금리는 하락 마감. 장기테너 금리 하락 폭이 커지면서 커브는 플래트닝 .글로벌 금리가 상승하는데 한국만 금리가 하락했고, IRS는 비드가 실종되면서 본드 스왑이 벌어짐.

CRS 금리는 전 구간에 걸쳐 상승. 최근 금리가 하락했던데 따른 반등이 나옴.