

IPS Daily Morning Brief

2017-09-14

종가 기준일 2017-09-13

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4200	0.00	1.4180	1.4274	1.4193	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4600	-0.25	1.4600	1.4745	1.4648	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5050	0.25	1.5040	1.5193	1.5080	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5575	0.00	1.5595	1.5834	1.5710	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6000	-0.50	1.6080	1.6318	1.6180	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6750	-0.75	1.6860	1.7104	1.6953	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7250	-0.75	1.7365	1.7653	1.7491	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7600	-0.75	1.7750	1.8078	1.7930	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8075	-1.00	1.8250	1.8653	1.8519	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8850	-0.75	1.9040	1.9463	1.9372	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9175	-0.75	1.9365	1.9778	1.9675	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9225	-0.75	1.9435	1.9904	1.9745	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9325	-0.75	1.9550	2.0089	1.9885	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.00	-0.25	4.20	4.71	4.55	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.50	0.50	4.40	4.48	4.32	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	9.50	-0.75	10.40	11.25	11.01	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.50	-0.25	7.80	7.86	7.73	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.50	-0.25	12.85	13.35	13.10	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.00	-0.25	16.70	17.60	17.49	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	5.05	5.49	5.38	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.50	0.00	8.90	9.74	9.76	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.00	3.85	4.25	4.39	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.75	-0.25	5.00	5.75	5.90	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	12.50	0.00	12.90	13.85	14.43	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.75	0.25	7.90	8.10	8.53	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.15	3.03	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	0.00	3.95	4.41	3.73	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.75	0.00	5.10	6.26	5.13	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.484	0.60	1.471	1.484	1.458	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.598	-0.10	1.597	1.618	1.586	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.675	-1.00	1.688	1.701	1.673	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.740	-1.20	1.756	1.770	1.752	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.895	-1.00	1.889	1.888	1.873	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.940	-1.20	1.952	1.977	1.954	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.129	-1.00	2.136	2.158	2.137	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.237	-1.00	2.248	2.275	2.256	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.272	-0.30	2.285	2.342	2.325	2.430	1.430	3.943	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.38	0.05	109.31	109.39	109.30
LKTb	124.64	0.11	124.40	124.65	124.35

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	2.10	-0.35	3.26	3.53	5.02	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-4.05	0.10	-3.77	-3.42	-1.51	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-7.50	0.50	-7.96	-6.92	-5.54	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-6.50	0.45	-6.96	-5.92	-5.68	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-17.00	0.25	-15.27	-12.31	-12.41	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-18.00	0.45	-17.68	-16.89	-16.14	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.15	0.00	-31.10	-29.24	-28.50	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-35.20	0.25	-34.36	-32.92	-31.89	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-33.95	-0.45	-32.96	-33.35	-33.69	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1128.50 (0.00)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-58.00	-1.25	1Y	0.9250	-1.00	1.3800	0.7650	1*2Y	3.00	1.50
-62.25	-0.50	1.5Y	0.9350	-0.50	1.2600	0.8100	2*3Y	7.00	1.00
-64.50	1.00	2Y	0.9550	0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	22.50	1.00
-65.00	2.25	3Y	1.0250	1.50	1.3150	0.7350	3*4Y	8.50	0.00
-61.50	2.25	4Y	1.1100	1.50	1.3750	0.6900	3*5Y	15.50	0.00
-58.00	2.25	5Y	1.1800	1.50	1.4350	0.6600	4*5Y	7.00	0.00
-56.25	2.00	7Y	1.2450	1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	6.50	-0.50
-50.00	1.75	10Y	1.3850	1.00	1.9050	0.6300	5*10Y	20.50	-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	1.3512	1.64	1.3348	1.3186	1.2620	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1902	2.12	2.1690	2.1323	2.0524	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	-0.3238	2.64	-0.3502	-0.3714	-0.4250	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0468	3.12	-0.0780	-0.1197	-0.1826	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	28.50	-0.25	28.75	30.00	29.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	56.20	0.00	56.20	56.20	54.80	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	83.90	0.48	83.42	81.37	79.04	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	60.25 / 60.5	SPRD							
03Y	68 / 68.5 / 68.75								
04Y									
05Y									
07Y									
10Y	89.5 / 89.75								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y 1.5 / 2.5 3*5y 15.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	72 건	-20	92	45	108	63	88	62	
금 액	18,925 억원	-5,825	24,750	13,905	32,376	15,215	25,560	17,644	

장종동향

채권은 미국금리 상승으로 하락 출발. 오후에 국고채 50년물 발행 무산과 30년물 발행 확대 소식에 강세 마감.

IRS는 비드 없는분위기가 계속되며 오퍼리시했고, 대부분구간 레벨 하락하며 커브 플랫 마감. 초장기쪽으로 관심이 쏠리며 장기 거래가 눈에 띄.

CRS는 1년, 1.5년을 제외하고 상승 마감.