IPS Daily Morning Brief

2017-09-15

종가 기준일 2017-09-14

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4250	0.50	1.4185	1.4270	1.4196	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4675	0.75	1.4605	1.4738	1.4651	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5100	0.50	1.5040	1.5183	1.5084	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5625	0.50	1.5580	1.5818	1.5714	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6025	0.25	1.6045	1.6296	1.6185	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6775	0.25	1.6815	1.7078	1.6962	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7275	0.25	1.7310	1.7621	1.7502	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7675	0.75	1.7690	1.8046	1.7942	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8175	1.00	1.8185	1.8616	1.8533	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8975	1.25	1.8970	1.9421	1.9387	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9300	1.25	1.9295	1.9738	1.9690	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9375	1.50	1.9360	1.9860	1.9762	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9475	1.50	1.9470	2.0039	1.9903	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	4.25	0.25	4.20	4.68	4.55	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.25	-0.25	4.35	4.45	4.33	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	9.25	-0.25	10.05	11.14	11.02	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.50	0.00	7.70	7.81	7.77	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.50	0.00	12.65	13.25	13.16	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.50	0.50	16.45	17.50	17.57	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	4.95	5.44	5.40	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.00	0.50	8.75	9.69	9.80	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	0.50	3.80	4.25	4.40	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.00	0.25	4.95	5.70	5.90	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.00	0.50	12.80	13.75	14.45	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	0.25	7.85	8.05	8.55	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.16	3.03	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.25	3.90	4.39	3.75	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.00	0.25	5.00	6.18	5.16	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.492	0.80	1.477	1.483	1.459	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.597	-0.10	1.598	1.615	1.587	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.680	0.50	1.683	1.699	1.674	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.737	-0.30	1.748	1.767	1.753	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.900	0.50	1.893	1.888	1.875	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.945	0.50	1.946	1.974	1.956	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.136	0.70	2.133	2.155	2.139	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.242	0.50	2.243	2.272	2.258	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.267	-0.50	2.276	2.336	2.326	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.25	0.01

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.39	0.01	109.36	109.40	109.35
LKTB	124.58	-0.06	124.52	124.64	124.52

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	1.80	-0.30	2.68	3.55	4.99	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-3.45	0.60	-3.96	-3.29	-1.52	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-7.75	-0.25	-7.89	-6.97	-5.55	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.95	0.55	-6.61	-5.92	-5.65	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-17.25	-0.25	-16.18	-12.57	-12.46	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-17.75	0.25	-17.74	-16.90	-16.14	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-31.85	0.30	-31.45	-29.35	-28.53	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-34.45	0.75	-34.56	-32.95	-31.92	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-31.95	2.00	-32.90	-33.25	-33.57	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-54.50	3.50
-59.75	2.50
-62.25	2.25
-63.75	1.25
-60.25	1.25
-57.25	0.75
-55.75	0.50
-49.75	0.25

CRS

USD/KRW 1132.60 (+4.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9650	4.00	1.3800	0.7650	1*2Y	1.50	-1.50
1.5Y	0.9650	3.00	1.2600	0.8100	2*3Y	6.00	-1.00
2Y	0.9800	2.50	1.2250	0.7950	2*5Y	21.50	-1.00
3Y	1.0400	1.50	1.3150	0.7350	3*4Y	8.50	0.00
4Y	1.1250	1.50	1.3750	0.6900	3*5Y	15.50	0.00
5Y	1.1950	1.50	1.4350	0.6600	4*5Y	7.00	0.00
7Y	1.2600	1.50	1.4500	0.6550	5*7Y	6.50	0.00
10Y	1.4000	1.50	1.9050	0.6300	5*10Y	20.50	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	1.3635	1.23	1.3512	1.3348	1.3186	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1867	-0.35	2.1902	2.1690	2.1323	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	-0.3165	0.73	-0.3238	-0.3502	-0.3714	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0553	-0.85	-0.0468	-0.0780	-0.1197	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	1.00	28.50	28.75	30.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	56.20	0.00	56.20	56.20	56.20	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	82.32	-1.58	83.90	83.42	81.37	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6y/78.50
06M	42.5		
09M			
01Y	50.75		
1.5Y			
02Y		SPRD	1*3/17
03Y	67.75		3*4/05
04Y	72.75		3*7/13.75
05Y			5*10/13
07Y	81.5		
10Y	89.5 89.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	66 건	-6	72	92	45	108	63	88
금 액	21,180 억원	2,255	18,925	24,750	13,905	32,376	15,215	25,560

장중동향

IRS는 미국 금리 상승에 영향을 받아 상승 마감. 특별한 이슈는 없었으나 그간 나오지 않던 비드가 나오면서 거래가 됨.

CRS 금리도 전 구간 상승 마감. 장기보다 단기 금리가 크게 오르면서 수익률 곡선은 평탄화됨. 단기쪽 부채 물량 때문에 3년이하로 비드가 쎄게 나옴.