

IPS Daily Morning Brief

2017-09-18

종가 기준일 2017-09-15

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4250	0.00	1.4210	1.4266	1.4200	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4675	0.00	1.4630	1.4730	1.4655	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5100	0.00	1.5060	1.5175	1.5088	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5625	0.00	1.5595	1.5803	1.5717	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6050	0.25	1.6045	1.6278	1.6191	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6775	0.00	1.6805	1.7053	1.6972	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7275	0.00	1.7305	1.7591	1.7513	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7650	-0.25	1.7680	1.8014	1.7954	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8175	0.00	1.8180	1.8579	1.8546	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8975	0.00	1.8965	1.9380	1.9402	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9300	0.00	1.9290	1.9696	1.9705	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9375	0.00	1.9355	1.9815	1.9778	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9475	0.00	1.9460	1.9988	1.9921	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.25	0.00	4.20	4.64	4.55	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.25	0.00	4.30	4.45	4.33	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	9.50	0.25	9.85	11.03	11.03	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.25	-0.25	7.60	7.75	7.81	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.25	-0.25	12.60	13.14	13.22	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.00	-0.50	16.35	17.36	17.63	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	5.00	5.39	5.41	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.75	-0.25	8.75	9.61	9.83	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.75	-0.25	3.75	4.23	4.42	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.25	0.25	5.00	5.65	5.92	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.25	0.25	12.85	13.66	14.48	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	0.00	7.85	8.01	8.56	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	0.00	3.90	4.35	3.77	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.00	0.00	4.95	6.08	5.19	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.496	0.40	1.484	1.482	1.459	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.597	0.00	1.598	1.612	1.587	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.680	0.00	1.682	1.698	1.675	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.737	0.00	1.745	1.765	1.754	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.902	0.20	1.902	1.888	1.877	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.950	0.50	1.948	1.971	1.957	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.143	0.70	2.138	2.153	2.140	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.250	0.80	2.246	2.268	2.260	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.270	0.30	2.273	2.330	2.327	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	109.40	0.01	109.37	109.41	109.36
LKTB	124.52	-0.06	124.53	124.65	124.48

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	1.40	-0.40	2.22	3.52	4.94	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-3.45	0.00	-3.85	-3.22	-1.53	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-7.50	0.25	-7.75	-7.03	-5.57	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.95	0.00	-6.41	-5.94	-5.64	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-17.45	-0.20	-17.13	-12.87	-12.54	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-18.50	-0.75	-18.04	-16.97	-16.18	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.55	-0.70	-31.96	-29.51	-28.58	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-35.25	-0.80	-34.91	-33.03	-31.98	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-32.25	-0.30	-32.68	-33.17	-33.51	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1131.70 (-0.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-54.50	0.00	1Y	0.9650	0.00	1.3800	0.7650	1*2Y	1.00	-0.50	
-60.25	-0.50	1.5Y	0.9600	-0.50	1.2600	0.8100	2*3Y	6.00	0.00	
-63.00	-0.75	2Y	0.9750	-0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	22.50	1.00	
-64.25	-0.50	3Y	1.0350	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	0.50	
-60.25	0.00	4Y	1.1250	0.00	1.3750	0.6900	3*5Y	16.50	1.00	
-56.50	0.75	5Y	1.2000	0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	7.50	0.50	
-55.25	0.50	7Y	1.2650	0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	6.50	0.00	
-49.25	0.50	10Y	1.4050	0.50	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	1.3843	2.08	1.3635	1.3512	1.3348	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2060	1.93	2.1867	2.1902	2.1690	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	-0.2957	2.08	-0.3165	-0.3238	-0.3502	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0440	1.13	-0.0553	-0.0468	-0.0780	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	29.25	-0.25	29.50	28.50	28.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	57.00	0.80	56.20	56.20	56.20	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	82.17	-0.15	82.32	83.90	83.42	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	51								
1.5Y									
02Y		SPRD	1*2Y 9.25						
03Y	67.5 / 67.75		5*6Y 2.25						
04Y			4*6Y 06						
05Y	76 / 76.25								
07Y									
10Y	89.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	47 건	-19	66	72	92	45	108	63	
금 액	11,980 억원	-9,200	21,180	18,925	24,750	13,905	32,376	15,215	

장종동향

국고채 금리, 북한 미사일 발사에 뚜렷한 방향성을 보이지 않으며 보험권 마감.

IRS, 북한 미사일 영향이 제한되면서 보험권 마감.

CRS 금리도 보험권 마감.