

IPS Daily Morning Brief

2017-09-19

종가 기준일 2017-09-18

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4300	0.50	1.4240	1.4264	1.4203	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4725	0.50	1.4660	1.4723	1.4660	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5175	0.75	1.5090	1.5169	1.5093	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5700	0.75	1.5620	1.5789	1.5721	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6125	0.75	1.6050	1.6260	1.6197	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6850	0.75	1.6795	1.7030	1.6982	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7375	1.00	1.7300	1.7566	1.7525	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7750	1.00	1.7670	1.7985	1.7968	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8275	1.00	1.8175	1.8545	1.8561	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9075	1.00	1.8960	1.9344	1.9418	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9400	1.00	1.9285	1.9660	1.9722	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9475	1.00	1.9350	1.9775	1.9797	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9575	1.00	1.9450	1.9941	1.9941	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.25	0.00	4.20	4.59	4.56	5.75	-6.00	5.75	-6.00
9*12M	4.50	0.25	4.30	4.46	4.34	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	9.50	0.00	9.60	10.91	11.04	12.75	-5.50	16.25	-8.00
2*3Y	7.25	0.00	7.45	7.70	7.85	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.50	0.25	12.50	13.06	13.28	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.25	0.25	16.20	17.25	17.71	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	0.25	5.05	5.36	5.43	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.00	0.25	8.75	9.55	9.86	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.75	0.00	3.70	4.19	4.43	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.25	0.00	5.05	5.60	5.93	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.25	0.00	12.90	13.59	14.50	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	0.00	7.85	7.99	8.57	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.16	3.04	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	3.90	4.31	3.78	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.00	0.00	4.90	5.98	5.23	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.505	0.90	1.491	1.483	1.460	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.602	0.50	1.599	1.610	1.588	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.689	0.90	1.682	1.697	1.676	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.740	0.30	1.741	1.762	1.755	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.907	0.50	1.902	1.888	1.879	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.957	0.70	1.949	1.969	1.959	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.157	1.40	2.141	2.152	2.142	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.267	1.70	2.249	2.266	2.262	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.295	2.50	2.276	2.326	2.329	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	109.38	-0.02	109.39	109.41	109.38
LKTB	124.35	-0.17	124.49	124.52	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	1.25	-0.15	1.80	3.44	4.91	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-3.20	0.25	-3.66	-3.15	-1.54	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-7.65	-0.15	-7.68	-7.07	-5.60	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.50	0.45	-6.17	-5.93	-5.64	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-16.95	0.50	-17.18	-13.14	-12.61	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-18.20	0.30	-18.18	-17.06	-16.21	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-32.95	-0.40	-32.33	-29.73	-28.64	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-35.95	-0.70	-35.26	-33.19	-32.05	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-33.75	-1.50	-33.08	-33.23	-33.47	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1126.60 (-5.10)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-54.75	-0.25	1Y	0.9700	0.50	1.3800	0.7650	1*2Y	1.50	0.50
-60.00	0.25	1.5Y	0.9700	1.00	1.2600	0.8100	2*3Y	6.00	0.00
-62.75	0.25	2Y	0.9850	1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	22.50	0.00
-64.00	0.25	3Y	1.0450	1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	0.00
-60.25	0.00	4Y	1.1350	1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	16.50	0.00
-56.50	0.00	5Y	1.2100	1.00	1.4350	0.6600	4*5Y	7.50	0.00
-55.25	0.00	7Y	1.2750	1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	6.50	0.00
-49.25	0.00	10Y	1.4150	1.00	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	1.3968	1.25	1.3843	1.3635	1.3512	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2306	2.46	2.2060	2.1867	2.1902	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	-0.2922	0.35	-0.2957	-0.3165	-0.3238	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0364	0.76	-0.0440	-0.0553	-0.0468	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	0.25	29.25	29.50	28.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	57.80	0.80	57.00	56.20	56.20	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	83.38	1.21	82.17	82.32	83.90	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	61	SPRD	3*4y	5.25					
03Y	68.25		3*5y	09					
04Y	73.5		10*20y	05					
05Y	73.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	48 건	1	47	66	72	92	45	108	
금 액	13,145 억원	1,165	11,980	21,180	18,925	24,750	13,905	32,376	

장중동향

채권은 미국금리 상승의 영향을 받아 약세 출발했고, FOMC를 앞두고 약보합 마감.

IRS는 FOMC와 국채선물 롤오버 때문에 조용한가운데 단기쪽은 오피가 없어서 거래가 뜸했고, 3~5년을 중심으로 스프레드 거래가 주를 이룸.

CRS는 비드만 조금 보이며 전구간 소폭 상승.