

IPS Daily Morning Brief

2017-09-21

종가 기준일 2017-09-20

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4350	-0.50	1.4310	1.4259	1.4213	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4825	-0.50	1.4755	1.4711	1.4672	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5325	-0.75	1.5220	1.5164	1.5109	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5875	-1.00	1.5760	1.5773	1.5735	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6375	-1.00	1.6210	1.6243	1.6216	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7150	-1.00	1.6960	1.7008	1.7007	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7675	-0.75	1.7470	1.7545	1.7554	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8025	-1.00	1.7845	1.7955	1.7998	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8575	-1.00	1.8375	1.8513	1.8596	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9325	-1.25	1.9160	1.9303	1.9453	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9650	-1.25	1.9485	1.9619	1.9758	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9750	-1.00	1.9565	1.9728	1.9835	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9850	-1.00	1.9665	1.9881	1.9983	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.75	0.00	4.45	4.53	4.59	5.75	-6.00	5.75	-6.00
9*12M	5.00	-0.25	4.65	4.53	4.37	5.25	-4.00	5.25	-4.25
1*2Y	10.50	-0.25	9.90	10.79	11.08	12.75	-5.50	16.25	-7.25
2*3Y	7.75	0.00	7.50	7.65	7.91	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.00	0.25	12.60	13.03	13.38	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.50	0.00	16.35	17.13	17.82	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	0.25	5.10	5.38	5.47	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.75	0.00	8.85	9.48	9.91	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	-0.25	3.75	4.10	4.45	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.50	0.00	5.30	5.58	5.98	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.00	-0.25	13.15	13.48	14.55	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.50	-0.25	7.85	7.90	8.57	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.16	3.05	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.25	4.05	4.25	3.82	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.25	5.05	5.79	5.29	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.503	-0.90	1.502	1.483	1.462	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.620	0.00	1.607	1.607	1.589	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.707	-1.40	1.695	1.695	1.678	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.770	-1.00	1.753	1.760	1.757	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.930	-1.50	1.917	1.891	1.883	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.975	-1.70	1.964	1.967	1.963	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.167	-1.70	2.157	2.151	2.147	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.274	-1.80	2.265	2.265	2.267	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.300	-1.70	2.290	2.320	2.332	2.430	1.430	3.943	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.00	0.05	108.95	109.00	108.89
LKTb	123.89	0.22	123.72	123.89	123.61

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	2.95	0.15	2.04	3.39	4.88	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-3.25	-1.00	-3.12	-2.97	-1.58	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-6.95	0.40	-7.44	-7.09	-5.63	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.50	0.00	-5.68	-5.92	-5.66	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-16.25	0.75	-16.98	-13.64	-12.73	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-17.25	0.70	-17.93	-17.16	-16.27	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-30.95	0.70	-31.99	-30.01	-28.69	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-34.15	0.55	-34.90	-33.44	-32.15	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-31.50	0.70	-32.33	-33.18	-33.33	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1128.30 (-3.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-53.75	0.25	1Y	0.9950	-0.50	1.3800	0.7650	1*2Y	2.50	1.50		
-58.25	1.50	1.5Y	1.0050	0.50	1.2600	0.8100	2*3Y	6.50	-0.50		
-61.75	2.00	2Y	1.0200	1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	20.00	-1.50		
-63.00	1.50	3Y	1.0850	0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	-0.50		
-60.75	0.75	4Y	1.1600	0.00	1.3750	0.6900	3*5Y	13.50	-1.00		
-58.25	0.50	5Y	1.2200	-0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	-0.50		
-57.75	0.50	7Y	1.2800	-0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	6.00	0.00		
-51.25	0.75	10Y	1.4200	-0.50	1.9050	0.6300	5*10Y	20.00	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	1.4423	3.71	1.4052	1.3968	1.3843	1.7169	0.5600	1.7169	0.2100
10Y	2.2722	2.39	2.2483	2.2306	2.2060	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	-0.2647	5.11	-0.3158	-0.2922	-0.2957	0.1019	-0.7700	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0018	4.19	-0.0437	-0.0364	-0.0440	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	29.75	29.50	29.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	56.70	-0.40	57.10	57.80	57.00	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	82.99	-1.32	84.31	83.38	82.17	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS		ODD Tenor	6y 83.75							
06M			8y 89.5							
09M										
01Y	54.25 / 55.5									
1.5Y	61.5									
02Y	66.75		SPRD	1.5*3y 12.75						
03Y	74 / 74.5			3*5y 8.5						
04Y	78 / 79.25			4*10y 16.25 / 16.5						
05Y	81 / 81.5									
07Y	87									
10Y	94 / 95.75									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6		
거래현황	124 건	26	98	48	47	66	72	92		
금 액	38,800 억원	19,817	18,983	13,145	11,980	21,180	18,925	24,750		

장중동향

채권은 외국인의 국채선물 매도에 약세를 보이다가 FOMC대기와 30년물 강세에 힘입어 상승 전환 마감.

IRS는 FOMC를 앞두고 등락을 거듭하다가 국채선물이 상승전환하며 레벨 하락, 커브는 플랫마감. 오전중에는 비드가 우위를 보 였고 오후 들어서는 단기와 장기물쪽으로 온쇼/엔디의 초이스가 나면서 거래활발.

CRS는 5년이상으로 오퍼가 나오면서 커브 플랫 마감.