IPS Daily Morning Brief

2017-09-26

종가 기준일 2017-09-25

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4500	1.00	1.4415	1.4273	1.4228	1.5575	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.5000	0.75	1.4915	1.4721	1.4692	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5500	0.75	1.5420	1.5181	1.5133	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.6175	1.25	1.6025	1.5783	1.5758	1.6175	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6650	1.25	1.6515	1.6261	1.6247	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7375	1.25	1.7260	1.7021	1.7039	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7875	1.25	1.7765	1.7553	1.7583	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8200	1.25	1.8105	1.7946	1.8022	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8725	1.25	1.8645	1.8498	1.8620	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9475	1.00	1.9410	1.9281	1.9474	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9800	1.00	1.9735	1.9600	1.9780	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9900	1.00	1.9830	1.9699	1.9863	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0000	1.00	1.9930	1.9829	2.0011	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.00	-0.25	5.00	4.49	4.64	5.75	-6.00	5.75	-6.00
9*12M	5.00	0.00	5.05	4.60	4.41	5.25	-4.00	5.25	-4.25
1*2Y	11.50	0.50	10.95	10.80	11.14	12.75	-5.50	16.25	-5.50
2*3Y	7.25	0.00	7.45	7.60	7.93	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.25	0.00	12.50	12.91	13.36	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	15.50	0.00	15.90	16.85	17.75	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	5.05	5.31	5.43	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.25	0.00	8.45	9.25	9.83	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.25	0.00	3.40	3.94	4.40	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.25	0.00	5.40	5.51	5.98	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	12.75	-0.25	13.05	13.35	14.52	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.50	-0.25	7.65	7.84	8.54	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.19	3.07	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.20	4.18	3.89	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.00	5.20	5.48	5.38	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.509	0.40	1.507	1.483	1.465	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.648	1.60	1.630	1.607	1.593	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.737	2.00	1.720	1.698	1.682	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.790	1.50	1.779	1.762	1.761	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.940	1.30	1.936	1.899	1.887	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.982	1.50	1.979	1.968	1.966	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.170	1.30	2.170	2.154	2.150	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.272	1.00	2.276	2.266	2.270	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.295	0.80	2.301	2.310	2.331	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	108.96	-0.05	108.99	109.03	108.96
LKTB	123.93	-0.11	123.97	124.07	123.93

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	4.10	0.35	3.54	3.49	4.85	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-3.05	-0.35	-2.79	-2.85	-1.73	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-7.20	-0.75	-6.89	-7.15	-5.76	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.25	-0.25	-5.30	-5.95	-5.73	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-15.25	-0.05	-15.93	-14.37	-12.90	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-16.20	-0.25	-16.87	-17.30	-16.39	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.75	-0.05	-30.55	-30.42	-28.77	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-32.45	0.00	-33.50	-33.75	-32.25	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-29.50	0.20	-30.78	-32.69	-33.00	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-56.00	-0.75
-62.25	-2.25
-65.50	-2.75
-67.25	-3.25
-64.75	-3.25
-62.00	-3.25
-61.25	-3.25
-54.75	-3.00

CRS

USD/KRW 1131.80 (-4.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9900	0.00	1.3800	0.7650	1*2Y	2.00	-1.50
1.5Y	0.9950	-1.00	1.2600	0.8100	2*3Y	5.50	-0.50
2Y	1.0100	-1.50	1.2250	0.7950	2*5Y	19.00	-0.50
3Y	1.0650	-2.00	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00
4Y	1.1400	-2.00	1.3750	0.6900	3*5Y	13.50	0.00
5Y	1.2000	-2.00	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.2600	-2.00	1.4500	0.6550	5*7Y	6.00	0.00
10Y	1.4000	-2.00	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	1.4271	-0.80	1.4351	1.4467	1.4423	1.7169	0.5600	1.7169	0.2200
10Y	2.2200	-3.18	2.2518	2.2784	2.2722	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	-0.3099	-2.8	-0.2819	-0.2733	-0.2647	0.1019	-0.7700	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0520	-4.18	-0.0102	-0.0016	-0.0018	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	28.25	-0.25	28.50	28.75	29.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	53.50	-1.00	54.50	56.00	56.70	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	79.29	-2.38	81.67	83.17	82.99	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	55		
1.5Y	61.5		
02Y		SPRD	5*10/13
03Y			
04Y			
05Y	81 81.5		
07Y			
10Y	94.25 94.5		
12Y			
15Y	98.25		
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	79 건	13	66	96	124	98	48	47
금 액	21,559 억원	3,325	18,234	33,158	38,800	18,983	13,145	11,980

장중동향

IRS는 국채선물에 연동해 오름세를 보이며 상승 마감. 2년이하 단기쪽은 비디쉬한 모습을 보이면서 오퍼가 나오면 바로 거래가 됐음. 10년이상 거래가 빈번하게 일어났으며 비드가 귀한모습을 보였음.

CRS 금리는 1년을 제외한 전 구간에서 하락. 특이 거래는 없었음.