IPS Daily Morning Brief

2017-09-28

종가 기준일 2017-09-27

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4775	2.25	1.4530	1.4319	1.4246	1.5525	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.5450	3.25	1.5090	1.4781	1.4714	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.6150	4.50	1.5645	1.5259	1.5163	1.6150	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.6975	5.25	1.6340	1.5873	1.5793	1.6975	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.7550	5.75	1.6850	1.6361	1.6285	1.7550	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.8400	6.00	1.7620	1.7130	1.7079	1.8400	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.8900	6.25	1.8115	1.7655	1.7618	1.8900	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.9325	7.00	1.8465	1.8045	1.8054	1.9325	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.9800	7.00	1.8975	1.8584	1.8648	1.9800	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.0575	7.50	1.9735	1.9364	1.9497	2.0575	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0900	7.50	2.0060	1.9685	1.9805	2.0900	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.1000	7.25	2.0165	1.9778	1.9891	2.1000	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.1075	7.00	2.0260	1.9898	2.0039	2.1075	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	6.75	1.00	5.60	4.63	4.68	6.75	-6.00	6.75	-6.00
9*12M	7.00	1.25	5.55	4.78	4.49	7.00	-4.00	7.00	-4.25
1*2Y	14.00	1.25	12.05	11.03	11.23	14.00	-5.50	16.25	-5.50
2*3Y	8.50	0.25	7.70	7.69	7.94	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.50	0.50	12.65	12.94	13.33	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.75	1.25	16.15	16.84	17.69	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.25	4.95	5.25	5.39	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.25	1.00	8.45	9.15	9.75	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.75	3.50	3.90	4.36	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.75	0.00	5.10	5.39	5.93	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	12.50	0.50	12.70	13.19	14.43	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.75	0.50	7.60	7.80	8.49	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.21	3.08	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	-0.25	4.30	4.14	3.95	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.00	-0.50	5.25	5.34	5.43	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.566	4.20	1.522	1.488	1.468	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.712	4.30	1.659	1.613	1.598	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.810	4.50	1.750	1.707	1.686	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.889	5.70	1.813	1.772	1.765	1.889	1.200	3.120	1.200
4Y	2.046	6.10	1.967	1.913	1.892	2.046	1.232	3.340	1.232
5Y	2.087	6.20	2.008	1.976	1.970	2.087	1.217	3.430	1.217
7Y	2.280	7.00	2.198	2.164	2.153	2.280	1.270	3.590	1.270
10Y	2.385	7.50	2.302	2.275	2.272	2.385	1.355	3.750	1.355
20Y	2.387	6.20	2.320	2.311	2.331	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	108.58	-0.22	108.77	108.78	108.55
LKTB	122.72	-0.80	123.44	123.49	122.72

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	4.90	0.30	4.29	3.77	4.82	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-1.45	0.95	-2.46	-2.62	-1.83	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-5.50	1.25	-6.48	-7.05	-5.79	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-4.90	0.30	-5.12	-5.87	-5.73	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-15.60	0.15	-15.55	-14.79	-13.00	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-15.45	0.80	-16.17	-17.20	-16.42	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-30.00	0.00	-30.03	-30.59	-28.79	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-32.75	0.00	-32.83	-33.88	-32.27	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-27.95	0.80	-29.38	-32.15	-32.67	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-62.00	-4.00
-70.75	-5.75
-75.50	-6.75
-78.50	-7.00
-76.00	-7.25
-74.75	-8.50
-73.50	-8.50
-67.25	-9.00

CRS

USD/KRW 1140.70 (+3.90)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9950	0.50	1.3800	0.7650	1*2Y	0.50	-1.50
1.5Y	0.9900	-0.50	1.2600	0.8100	2*3Y	5.50	0.00
2Y	1.0000	-1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	18.50	-0.50
3Y	1.0550	-1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00
4Y	1.1300	-1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	13.00	-0.50
5Y	1.1850	-1.50	1.4350	0.6600	4*5Y	5.50	-0.50
7Y	1.2450	-1.50	1.4500	0.6550	5*7Y	6.00	0.00
10Y	1.3850	-1.50	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	1.4663	3.48	1.4315	1.4271	1.4351	1.7169	0.5600	1.7169	0.2300
10Y	2.3114	7.37	2.2377	2.2200	2.2518	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	-0.3437	-1.02	-0.3335	-0.3099	-0.2819	0.1019	-0.7550	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0736	-0.13	-0.0723	-0.0520	-0.0102	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	30.25	1.75	28.50	28.25	28.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	57.50	3.00	54.50	53.50	54.50	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	84.51	3.89	80.62	79.29	81.67	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	58 / 58.25 / 58.75 / 58.75 / 61.5		
1.5Y			
02Y	72 / 72.25 / 74 / 75.5	SPRD	6*9M 06
03Y	80.25 / 80.5 / 80.75 / 81		5*9Y 10
04Y			
05Y	93.25		
07Y	97.5		
10Y	00		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1*3Y 07		

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	174 건	39	135	79	66	96	124	98
금 액	60,902 억원	24,637	36,265	21,559	18,234	33,158	38,800	18,983

장중동향

국고채 금리, 외인의 현·선물 매도에 이틀 연속 큰 폭 상승.
외인은 이날 국고채 1조원 가량 순매도, 3년 국채선물 1만4천계약 가량 매도.

IRS, 외인의 국채선물 대량 매도와 금통위원 매파 발언 등이 겹치면서 시장 패닉. 금리 급등.
장중 비드가 급증하면서 금리 상승폭 확대. 오퍼가 나오면 빠르게 테이큰되는 양상.
1-3Y 구간 호가가 많았고, 10Y을 제외한 5Y 이상 구간에서는 호가가 귀했음.
CRS, 상대적으로 금리 변동폭이 제한되며 하락 마감.