

IPS Daily Morning Brief

2017-09-29

종가 기준일 2017-09-28

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4775	0.00	1.4600	1.4348	1.4255	1.5525	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.5475	0.25	1.5195	1.4824	1.4727	1.5475	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.6175	0.25	1.5790	1.5314	1.5180	1.6175	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.7000	0.25	1.6530	1.5936	1.5814	1.7000	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.7600	0.50	1.7060	1.6430	1.6310	1.7600	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.8500	1.00	1.7865	1.7206	1.7105	1.8500	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.9025	1.25	1.8365	1.7729	1.7643	1.9025	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.9475	1.50	1.8740	1.8119	1.8078	1.9475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.9975	1.75	1.9240	1.8653	1.8670	1.9975	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.0775	2.00	2.0005	1.9433	1.9517	2.0775	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.1100	2.00	2.0330	1.9755	1.9826	2.1100	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.1225	2.25	2.0440	1.9848	1.9915	2.1225	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.1300	2.25	2.0530	1.9961	2.0062	2.1300	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	7.00	0.25	5.95	4.76	4.72	7.00	-6.00	7.00	-6.00
9*12M	7.00	0.00	5.95	4.90	4.53	7.00	-4.00	7.00	-4.25
1*2Y	14.25	0.25	12.70	11.16	11.29	14.25	-5.50	16.25	-5.50
2*3Y	9.00	0.50	8.05	7.76	7.96	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.25	0.75	13.05	12.99	13.33	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.75	1.00	16.80	16.89	17.69	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	0.25	5.00	5.23	5.37	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	0.50	8.75	9.13	9.73	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.25	3.75	3.90	4.36	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.00	0.25	5.00	5.34	5.91	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.00	0.50	12.65	13.14	14.39	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	0.25	7.65	7.80	8.48	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.23	3.09	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.25	4.35	4.15	3.98	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.25	5.25	5.29	5.45	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.573	0.70	1.535	1.493	1.470	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.724	1.20	1.677	1.620	1.600	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.810	0.00	1.768	1.713	1.689	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.890	0.10	1.835	1.779	1.768	1.890	1.200	3.120	1.200
4Y	2.053	0.70	1.990	1.923	1.894	2.053	1.232	3.340	1.232
5Y	2.095	0.80	2.031	1.983	1.972	2.095	1.217	3.430	1.217
7Y	2.294	1.40	2.222	2.172	2.155	2.294	1.270	3.590	1.270
10Y	2.405	2.00	2.327	2.282	2.274	2.405	1.355	3.750	1.355
20Y	2.392	0.50	2.337	2.314	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	108.57	-0.01	108.56	108.63	108.47
LKTB	122.55	-0.17	122.60	122.95	122.23

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	4.45	-0.45	4.36	3.81	4.78	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-2.40	-0.95	-2.40	-2.60	-1.88	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-5.00	0.50	-6.18	-7.02	-5.78	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-4.00	0.90	-4.87	-5.82	-5.70	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-15.05	0.55	-15.37	-14.99	-13.02	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-14.75	0.70	-15.72	-17.10	-16.38	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.65	0.35	-29.82	-30.63	-28.77	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-32.75	0.00	-32.63	-33.88	-32.27	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-26.20	1.75	-28.42	-31.77	-32.48	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1149.10 (+8.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-62.25	-0.25	1Y	0.9950	0.00	1.3800	0.7650	1*2Y	1.50	1.00		
-70.50	0.25	1.5Y	0.9950	0.50	1.2600	0.8100	2*3Y	6.50	1.00		
-75.00	0.50	2Y	1.0100	1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	20.00	1.50		
-77.50	1.00	3Y	1.0750	2.00	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00		
-75.25	0.75	4Y	1.1500	2.00	1.3750	0.6900	3*5Y	13.50	0.50		
-73.75	1.00	5Y	1.2100	2.50	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	0.50		
-72.75	0.75	7Y	1.2700	2.50	1.4500	0.6550	5*7Y	6.00	0.00		
-66.75	0.50	10Y	1.4100	2.50	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	1.4505	-1.58	1.4663	1.4315	1.4271	1.7169	0.5600	1.7169	0.2300
10Y	2.3078	-0.36	2.3114	2.2377	2.2200	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	-0.3595	-1.58	-0.3437	-0.3335	-0.3099	0.1019	-0.7190	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0972	-2.36	-0.0736	-0.0723	-0.0520	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	31.75	1.50	30.25	28.50	28.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	59.50	2.00	57.50	54.50	53.50	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	85.73	1.22	84.51	80.62	79.29	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M					ODD Tenor	9y/5.25			
09M	54								
01Y	61	61.5	62.5						
1.5Y									
02Y	75.5	75.25	78						
03Y	84.75	87.25	85		SPRD	1*3y/24.75			
04Y						3*7y/14.5			
05Y	93					3*7y/15			
07Y						3*9y/20.5			
10Y	5.75	06				9*12m/07			
12Y						2*5*10y/4.5			
15Y						2*5*10y/4.75			
20Y						5*10y/13			
						2*5y/17.5			
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	159 건	-15	174	135	79	66	96	124	
금 액	56,651 억원	-4,251	60,902	36,265	21,559	18,234	33,158	38,800	

장중동향

IRS는 상승 마감. 단기보다 장기 구간 금리가 더 오르면서 수익률 곡선은 가팔라짐. 장중 10년이 전일 대비 7bp 오른 수준에서 거래가 이뤄지는 등 상승장이었음.

증권이 막판 국채선물을 매수하기 시작하면서 IRS도 상승 폭을 줄여 마감함.

CRS 금리도 대체로 상승세를 보이며 마감. 여전히 글로벌 금리는 상승중이고 외국인 흐름에 취약한 장이 이어지고 있음.