

IPS Daily Morning Brief

2017-10-11

종가 기준일 2017-10-10

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4800	1.00	1.4720	1.4544	1.4329	1.5375	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.5450	1.25	1.5350	1.5101	1.4817	1.5475	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.6150	1.25	1.6050	1.5694	1.5304	1.6175	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.7100	2.25	1.6920	1.6415	1.5970	1.7100	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.7800	3.25	1.7540	1.6951	1.6480	1.7800	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.8700	3.50	1.8420	1.7765	1.7284	1.8700	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.9250	4.00	1.8930	1.8270	1.7812	1.9250	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.9675	4.00	1.9355	1.8661	1.8234	1.9675	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	2.0250	5.00	1.9850	1.9165	1.8798	2.0250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.1050	5.25	2.0630	1.9941	1.9625	2.1050	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.1375	5.25	2.0955	2.0266	1.9941	2.1375	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.1500	5.25	2.1080	2.0371	2.0043	2.1500	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.1575	5.25	2.1155	2.0459	2.0187	2.1575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	6.50	0.25	6.30	5.58	4.88	7.00	-6.00	7.00	-6.00
9*12M	7.00	0.00	7.00	5.93	4.87	7.00	-4.00	7.00	-4.25
1*2Y	16.50	2.00	14.90	12.58	11.76	16.50	-5.50	16.50	-5.50
2*3Y	9.00	0.25	8.80	8.14	8.04	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.50	0.75	13.90	13.19	13.32	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.75	0.75	18.15	17.10	17.54	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.50	5.10	5.05	5.28	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	0.50	9.35	8.96	9.50	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.00	4.25	3.91	4.22	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.75	1.00	4.95	5.04	5.63	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.75	1.25	12.75	12.80	13.91	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	0.25	7.80	7.76	8.28	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.25	3.16	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.00	4.50	4.30	4.18	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.00	5.25	5.17	5.62	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.598	2.80	1.576	1.538	1.487	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.749	2.50	1.729	1.673	1.621	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.826	1.60	1.813	1.760	1.708	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.942	5.50	1.898	1.831	1.786	1.942	1.200	3.120	1.200
4Y	2.101	6.00	2.053	1.988	1.917	2.101	1.232	3.340	1.232
5Y	2.140	6.30	2.090	2.029	1.988	2.140	1.217	3.430	1.217
7Y	2.318	5.30	2.276	2.219	2.171	2.318	1.270	3.590	1.270
10Y	2.417	4.60	2.380	2.325	2.288	2.417	1.355	3.750	1.355
20Y	2.397	3.20	2.371	2.333	2.337	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	108.48	-0.14	108.58	108.59	108.44
LKTB	122.42	-0.43	122.73	122.81	122.30

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	1.70	-1.55	2.94	3.13	4.32	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-3.90	-0.25	-3.70	-3.19	-2.40	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-4.60	1.65	-5.92	-6.52	-6.02	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-7.20	-2.00	-5.60	-5.41	-5.76	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-17.60	-2.00	-16.00	-16.08	-13.54	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-17.25	-2.30	-15.41	-16.26	-16.51	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.30	-0.30	-29.06	-30.21	-29.11	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-31.20	0.65	-31.72	-33.04	-32.58	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-23.95	2.05	-25.59	-28.73	-31.83	-14.50	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1135.10 (-10.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-57.00	2.75	1Y	1.0450	4.00	1.3300	0.7650	1*2Y	6.00	2.00	
-63.50	2.75	1.5Y	1.0750	5.00	1.1750	0.8100	2*3Y	8.00	0.50	
-67.50	2.75	2Y	1.1050	6.00	1.2250	0.7950	2*5Y	24.00	0.50	
-68.50	3.00	3Y	1.1850	6.50	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	0.00	
-65.00	2.50	4Y	1.2750	6.50	1.3750	0.6900	3*5Y	16.00	0.00	
-62.25	2.50	5Y	1.3450	6.50	1.4350	0.6600	4*5Y	7.00	0.00	
-60.50	1.50	7Y	1.4200	6.50	1.4500	0.6550	5*7Y	7.50	0.00	
-52.50	1.75	10Y	1.5800	7.00	1.5800	0.6300	5*10Y	23.50	0.50	

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	1.5164	0.83	1.5081	1.5121	1.4913	1.7169	0.5600	1.7169	0.2500
10Y	2.3600	-0.08	2.3608	2.3608	2.3500	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	-0.3096	-0.77	-0.3019	-0.2979	-0.3187	0.1019	-0.7120	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0570	-4.68	-0.0102	-0.0102	-0.0210	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	32.50	2.00	30.50	30.50	30.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	59.10	3.00	56.10	56.10	56.10	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	84.36	-0.91	85.27	84.87	85.87	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y	61.25 / 61.5								
1.5Y									
02Y					SPRD	1*2Y 16			
03Y	86 / 87					3*7Y 15			
04Y									
05Y	95.75								
07Y									
10Y	10.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	85 건		-6	91	0	0	0	0	0
금 액	30,060 억원		-2,842	32,902	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000

장중동향

국고채 금리, 상승 마감.
외인의 대규모 국채선물 매도와 국고채 5년물 입찰 부진 영향. (국고 5년 1.35조 2.135%에 낙찰...응찰 3.92조)

IRS, 전 테너 금리 상승하며 커브 스티프닝.
증시와 원화가 강세를 보인 가운데 채권시장만 약세. 시장에서는 기준금리 인상을 반영한 것으로 해석.
5년 이하 구간을 중심으로 비드가 우세해 주로 테이큰 되며 거래되는 분위기.

CRS 금리도 미국의 연내 추가금리인상 가능성이 커짐에 따라 크게 상승해 마감. 비드가 강한 모습.