

IPS Daily Morning Brief

2017-10-13

종가 기준일 2017-10-12

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4675	-0.75	1.4725	1.4593	1.4350	1.5350	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.5350	-0.25	1.5365	1.5174	1.4843	1.5475	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.6000	-0.50	1.6050	1.5789	1.5338	1.6175	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.6900	-1.00	1.6950	1.6550	1.6014	1.7100	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.7500	-2.00	1.7590	1.7110	1.6528	1.7800	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.8350	-2.25	1.8465	1.7935	1.7334	1.8700	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.8900	-2.25	1.8995	1.8445	1.7864	1.9250	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.9350	-2.00	1.9425	1.8843	1.8285	1.9675	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.9900	-2.25	1.9955	1.9354	1.8848	2.0250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.0700	-2.25	2.0745	2.0131	1.9672	2.1050	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.1025	-2.25	2.1070	2.0456	1.9990	2.1375	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.1150	-2.25	2.1195	2.0568	2.0094	2.1500	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.1275	-2.25	2.1290	2.0658	2.0239	2.1575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	6.75	0.50	6.40	5.81	4.93	7.00	-6.00	7.00	-6.00
9*12M	6.50	-0.25	6.85	6.15	4.95	7.00	-4.00	7.00	-4.25
1*2Y	15.00	-1.50	15.40	13.21	11.91	16.50	-5.50	16.50	-5.50
2*3Y	8.50	-0.25	8.75	8.25	8.06	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.00	-0.25	14.05	13.35	13.36	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.50	0.00	18.35	17.33	17.56	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.00	5.30	5.10	5.30	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.00	0.25	9.60	9.08	9.50	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.25	4.30	3.98	4.20	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.50	-0.25	5.30	5.11	5.63	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.50	-0.25	13.20	12.89	13.87	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	0.00	7.90	7.78	8.24	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.25	3.19	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.00	4.50	4.36	4.23	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.75	0.00	5.45	5.26	5.68	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.620	1.00	1.594	1.551	1.493	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.749	0.90	1.737	1.688	1.627	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.835	2.70	1.818	1.775	1.714	1.835	1.225	2.990	1.225
3Y	1.895	-2.70	1.907	1.848	1.792	1.942	1.200	3.120	1.200
4Y	2.060	-3.00	2.067	2.006	1.924	2.101	1.232	3.340	1.232
5Y	2.100	-3.00	2.105	2.046	1.994	2.140	1.217	3.430	1.217
7Y	2.281	-3.40	2.289	2.235	2.177	2.318	1.270	3.590	1.270
10Y	2.380	-3.80	2.391	2.340	2.293	2.418	1.355	3.750	1.355
20Y	2.375	-1.00	2.377	2.344	2.340	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	108.62	0.09	108.55	108.63	108.55
LKTb	122.85	0.42	122.50	122.85	122.50

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	-2.00	-1.50	1.14	2.81	4.07	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-5.90	-1.90	-4.22	-3.31	-2.60	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-8.50	-4.70	-5.88	-6.38	-6.09	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-6.00	0.45	-6.01	-5.41	-5.81	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-17.00	0.75	-16.71	-16.10	-13.71	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-16.50	1.00	-16.23	-16.17	-16.59	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-29.10	1.15	-29.33	-29.98	-29.21	-7.50	-37.65	-3.75	-37.65
10Y	-31.00	1.55	-31.69	-32.73	-32.63	-12.95	-38.70	-2.75	-38.70
20Y	-24.75	-1.25	-24.84	-27.85	-31.57	-15.75	-48.50	-1.45	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1133.20 (-2.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-50.50	1.50	1Y	1.0950	1.00	1.3300	0.7650	1*2Y	8.00	1.00		
-55.50	2.50	1.5Y	1.1350	1.50	1.1750	0.8100	2*3Y	8.50	0.50		
-57.50	4.00	2Y	1.1750	2.00	1.2250	0.7950	2*5Y	25.00	0.50		
-57.50	4.75	3Y	1.2600	2.50	1.3150	0.7350	3*4Y	9.50	0.00		
-53.50	4.75	4Y	1.3550	2.50	1.3750	0.6900	3*5Y	16.50	0.00		
-51.00	4.50	5Y	1.4250	2.50	1.4350	0.6600	4*5Y	7.00	0.00		
-49.00	4.75	7Y	1.5000	2.50	1.5000	0.6550	5*7Y	7.50	0.00		
-41.00	4.75	10Y	1.6600	2.50	1.6600	0.6300	5*10Y	23.50	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	1.5168	0.43	1.5125	1.5164	1.5081	1.7169	0.5600	1.7169	0.2600
10Y	2.3198	-3.03	2.3501	2.3600	2.3608	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	-0.3182	-2.27	-0.2955	-0.3096	-0.3019	0.1019	-0.7120	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0602	0.77	-0.0679	-0.0570	-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	32.00	-0.25	32.25	32.50	30.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	54.50	-6.50	61.00	59.10	56.10	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	80.30	-3.46	83.76	84.36	85.27	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	46.75								
09M	53.25 / 53.5								
01Y	60.25								
1.5Y									
02Y	76.25				SPRD	9m*2y	22		
03Y	84.5 / 84.75 / 85					9m*3y	30.5		
04Y	90.5					1*2y	16		
05Y	94.75					3*4y	5.5		
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y 09								
	2y 16								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황		143 건	21	122	85	91	0	0	0
금 액		37,780 억원	-1,755	39,535	30,060	32,902	0,000	0,000	0,000

장종동향

채권은 저가매수가 유입되며 상승했고, 장종 금리 하락세를 유지.

IRS는 저가매수의 영향으로 채권과 연동해 금리 하락하며 컷프 소폭 플레트닝.

CRS는 비디시한 분위기가 이어졌지만 오퍼도 유입. 레벨은 상승마감.