IPS Daily Morning Brief

2017-09-22

종가 기준일 2017-09-21

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4425	0.75	1.4345	1.4261	1.4218	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4950	1.25	1.4810	1.4711	1.4678	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5450	1.25	1.5290	1.5166	1.5117	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.6050	1.75	1.5845	1.5769	1.5742	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6550	1.75	1.6315	1.6240	1.6226	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7275	1.25	1.7060	1.7001	1.7018	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7775	1.00	1.7570	1.7538	1.7565	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8100	0.75	1.7930	1.7941	1.8009	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8650	0.75	1.8470	1.8498	1.8608	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9425	1.00	1.9250	1.9285	1.9465	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9750	1.00	1.9575	1.9601	1.9770	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9850	1.00	1.9660	1.9708	1.9849	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9950	1.00	1.9760	1.9853	1.9997	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	5.25	0.50	4.65	4.50	4.61	5.75	-6.00	5.75	-6.00
9*12M	5.00	0.00	4.80	4.55	4.38	5.25	-4.00	5.25	-4.25
1*2Y	11.00	0.50	10.25	10.74	11.10	12.75	-5.50	16.25	-7.25
2*3Y	7.25	-0.50	7.45	7.61	7.92	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.25	-0.75	12.55	12.98	13.39	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	15.50	-1.00	16.15	17.01	17.83	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	-0.25	5.10	5.36	5.47	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.25	-0.50	8.70	9.40	9.90	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.25	-0.25	3.60	4.04	4.44	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.50	0.00	5.40	5.56	5.99	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.25	0.25	13.20	13.44	14.56	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.75	0.25	7.80	7.88	8.57	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.16	3.05	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.10	4.23	3.84	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.00	5.10	5.68	5.33	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.504	0.10	1.504	1.482	1.463	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.632	1.20	1.614	1.606	1.590	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.720	1.30	1.703	1.695	1.679	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.780	1.00	1.761	1.759	1.759	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.937	0.70	1.924	1.892	1.884	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.980	0.50	1.971	1.966	1.964	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.172	0.50	2.165	2.151	2.148	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.280	0.60	2.273	2.264	2.268	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.305	0.50	2.297	2.316	2.332	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.24	-0.01

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	108.98	-0.02	108.92	108.99	108.90
LKTB	123.86	-0.03	123.67	123.91	123.62

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	1.15	2.50	3.45	4.89	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-2.70	0.55	-2.97	-2.88	-1.61	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-6.50	0.45	-7.19	-7.08	-5.66	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.25	0.25	-5.54	-5.88	-5.69	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-15.95	0.30	-16.72	-13.87	-12.79	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-17.00	0.25	-17.78	-17.21	-16.31	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-30.70	0.25	-31.76	-30.15	-28.72	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-33.75	0.40	-34.76	-33.56	-32.19	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-31.00	0.50	-32.14	-33.06	-33.23	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-54.50	-0.75
-59.00	-0.75
-62.00	-0.25
-62.75	0.25
-60.25	0.50
-57.50	0.75
-57.00	0.75
-50.75	0.50

CRS

USD/KRW 1132.70 (+4.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.0000	0.50	1.3800	0.7650	1*2Y	3.50	1.00
1.5Y	1.0150	1.00	1.2600	0.8100	2*3Y	6.50	0.00
2Y	1.0350	1.50	1.2250	0.7950	2*5Y	20.00	0.00
3Y	1.1000	1.50	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00
4Y	1.1750	1.50	1.3750	0.6900	3*5Y	13.50	0.00
5Y	1.2350	1.50	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.2950	1.50	1.4500	0.6550	5*7Y	6.00	0.00
10Y	1.4350	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	1.4467	0.44	1.4423	1.4052	1.3968	1.7169	0.5600	1.7169	0.2200
10Y	2.2784	0.62	2.2722	2.2483	2.2306	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	-0.2733	-0.86	-0.2647	-0.3158	-0.2922	0.1019	-0.7700	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0016	0.02	-0.0018	-0.0437	-0.0364	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	28.75	-0.75	29.50	29.75	29.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	56.00	-0.70	56.70	57.10	57.80	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	83.17	0.18	82.99	84.31	83.38	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	55 54.5 54.25		
1.5Y	60 60.5		
02Y	65.5	SPRD	1*4/24
03Y	72.25 72.5		1*2/11
04Y	79 77.5		3*4/5.25
05Y	81.75 81		1.5*3/12.5
07Y	86.5		1.5*2/05
10Y			
12Y	98.25		
15Y			
20Y			
CRS	1Y/1.0000		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	96 건	-28	124	98	48	47	66	72
금 액	33,158 억원	-5,642	38,800	18,983	13,145	11,980	21,180	18,925

장중동향

IRS는 미국이 12월에 금리를 인상하면 한국도 금리를 올릴 수밖에 없다는 인식 때문인지 단기구간에서 비드가 많았음. 4년 오퍼가 귀한 모습을 보였으며 1년,2년,5년 거래가 많은편이였음.

CRS 역시 비드가 많았고, 당분간은 이런 흐름이 이어질 것으로 예상됨. 크로스도 상승 마감.