IPS Daily Morning Brief

2017-08-18

종가 기준일 2017-08-17

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4325	-0.75	1.4330	1.4186	1.4102	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4825	-0.50	1.4780	1.4616	1.4491	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5300	-0.50	1.5240	1.5041	1.4878	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5950	-1.00	1.5915	1.5674	1.5441	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6450	-1.00	1.6405	1.6179	1.5867	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7300	-1.25	1.7275	1.6990	1.6589	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7900	-0.75	1.7830	1.7526	1.7106	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8300	-1.00	1.8225	1.7965	1.7545	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8900	-1.00	1.8810	1.8573	1.8155	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9800	-1.00	1.9710	1.9463	1.9045	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0100	-1.00	2.0010	1.9778	1.9362	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0250	-0.75	2.0140	1.9855	1.9420	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0475	-0.75	2.0365	2.0021	1.9515	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.00	0.25	4.50	4.30	3.89	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.75	0.00	4.60	4.25	3.87	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.50	-0.50	11.65	11.38	9.89	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.50	-0.25	8.70	8.11	7.23	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.50	0.25	14.25	13.48	12.40	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.50	0.00	18.20	17.86	16.78	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	6.00	0.50	5.55	5.36	5.17	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.00	0.25	9.50	9.75	9.55	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.00	-0.25	3.95	4.39	4.38	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.00	0.00	5.85	6.08	6.10	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.00	0.00	14.85	14.98	15.00	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.00	0.00	9.00	8.90	8.90	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	3.15	3.18	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.25	4.30	3.93	3.75	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	6.75	0.25	6.55	5.59	4.70	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.516	0.00	1.506	1.446	1.443	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.655	-1.50	1.657	1.579	1.563	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.712	-2.00	1.716	1.667	1.643	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.791	-2.90	1.805	1.760	1.718	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.911	-2.10	1.917	1.877	1.842	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	2.005	-2.00	2.007	1.964	1.919	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.187	-1.60	2.183	2.140	2.108	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.317	-1.50	2.310	2.268	2.229	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.387	0.00	2.369	2.338	2.313	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.39	0.00
CALL	1.21	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.11	0.07	109.08	109.12	109.07
LKTB	123.71	0.12	123.78	123.89	123.68

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	1.40	-0.50	1.80	5.84	4.43	9.00	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-6.00	0.50	-6.53	-1.19	-1.88	2.40	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-6.70	1.00	-7.57	-4.92	-5.59	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-6.10	1.65	-7.79	-6.11	-5.95	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.10	1.35	-13.40	-12.47	-13.17	-3.20	-30.35	5.00	-30.35
5Y	-17.50	1.00	-18.43	-16.71	-16.47	-2.25	-27.25	7.00	-27.25
7Y	-29.70	0.60	-30.24	-28.30	-29.21	-7.50	-37.65	1.75	-37.65
10Y	-33.70	0.50	-33.86	-32.20	-32.41	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-33.95	-0.75	-33.27	-33.60	-36.18	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-62.50	1.00
-65.50	1.00
-67.00	0.50
-67.00	0.25
-64.00	-0.25
-61.50	0.50
-62.00	0.50
-59.50	0.50

CRS

USD/KRW 1137.20 (-4.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9050	0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	7.00	-1.00
1.5Y	0.9400	0.00	1.2850	0.8100	2*3Y	8.50	-0.50
2Y	0.9750	-0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	24.00	0.00
3Y	1.0600	-1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	0.00
4Y	1.1500	-1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	15.50	0.50
5Y	1.2150	-0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	6.50	0.50
7Y	1.2700	-0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	5.50	0.00
10Y	1.3850	-0.50	1.9050	0.6300	5*10Y	17.00	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	1.3017	-3.26	1.3343	1.3505	1.3263	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1888	-3.84	2.2272	2.2746	2.2220	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	-0.4103	-1.26	-0.3977	-0.3695	-0.3937	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	0.1282	2.34	0.1048	0.0274	0.0800	0.1282	-0.4740	1.2400	-0.4740

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	33.50	0.00	33.50	32.75	32.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	60.50	0.50	60.00	58.20	58.20	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	88.71	-0.58	89.29	92.41	89.57	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	
09M	48		
01Y	53		
1.5Y	59 / 59.5		
02Y	64 / 64.5	SPRD	9M*2Y 16.25
03Y	72.5 / 73		3*4Y 06
04Y	79		3*10Y 24.75
05Y	82 / 83		5*10Y 14.75
07Y			10*12Y 03
10Y	97.5		
12Y	0.5		1*1.5*2Y FLY 02
15Y			
20Y			
CRS	3Y 04		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	69 건	-25	94	46	46	78	136	138
금 액	17,993 억원	-10,612	28,605	18,930	18,930	19,191	25,814	54,495

장중동향

국고채 금리, 하락 마감.

미 채권금리가 강세를 보인 가운데 북 리스크 완화로 외인이 3년과 10년 국채선물을 매수한 영향. 외인은 11거래일 만에 3년 국채선물을 처음으로 순매수. 다만 지정학적 리스크가 완전히 해소됐다고 보기는 어렵기 때문에 다음주 을지훈련 때까지는 시장은 경계감을 갖고 지켜볼 것으로 추측되면서 장중 강세폭이 제한됨.

IRS, 국고채 금리가 전반적으로 강세를 보임에 따라 IRS도 연동되어 금리 하락 마감.

장중 거래는 적었으나, 4시를 전후로 3년과 4년 위주의 거래가 급증. 비드가 많이 보이면서 금리 일부 되돌림.

CRS, 1.5년 이하 구간을 제외하고 모두 하락. IRS 금리가 갭 다운한 영향으로 오퍼가 우위를 보임.