IPS Daily Morning Brief

2017-08-30

종가 기준일 2017-08-29

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4250	-1.00	1.4340	1.4305	1.4156	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4775	-1.00	1.4880	1.4781	1.4586	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5225	-1.00	1.5330	1.5219	1.4996	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5900	-0.75	1.6010	1.5893	1.5594	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6325	-0.50	1.6450	1.6381	1.6032	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7075	-0.25	1.7215	1.7209	1.6770	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7625	-0.25	1.7750	1.7760	1.7287	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8050	-0.25	1.8185	1.8194	1.7719	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8650	0.00	1.8765	1.8801	1.8312	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9450	0.00	1.9580	1.9668	1.9178	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9750	0.00	1.9890	1.9981	1.9488	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9925	0.00	2.0055	2.0103	1.9553	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0125	-0.50	2.0295	2.0313	1.9673	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.25	0.00	5.40	4.76	4.30	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.50	0.00	4.50	4.38	4.10	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	11.00	0.50	11.20	11.63	10.36	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.50	0.25	7.65	8.28	7.38	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.00	0.25	13.00	13.79	12.55	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.25	0.25	17.35	18.13	16.87	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.00	5.35	5.51	5.18	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	0.00	9.70	9.85	9.49	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.00	4.35	4.34	4.32	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.00	0.25	5.80	6.08	5.93	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	14.00	0.25	13.95	14.74	14.59	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	0.00	8.15	8.66	8.66	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.10	3.14	3.10	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.75	4.35	3.75	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	6.75	-0.50	7.15	6.45	4.95	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	0.70	1.503	1.479	1.452	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.635	0.50	1.641	1.623	1.578	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.707	0.70	1.711	1.698	1.658	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.770	1.00	1.775	1.785	1.735	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.880	1.00	1.886	1.898	1.856	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.975	1.30	1.978	1.990	1.935	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.146	1.00	2.153	2.167	2.118	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.255	0.50	2.268	2.291	2.237	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.347	-0.30	2.362	2.368	2.315	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	-0.01
CALL	1.23	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.22	-0.04	109.22	109.25	109.18
LKTB	124.35	-0.10	124.25	124.42	124.18

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	1.85	-1.70	2.96	4.33	4.80	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-4.50	-1.25	-4.00	-3.40	-1.90	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-7.45	-1.20	-6.62	-6.01	-5.52	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-6.25	-1.25	-5.39	-6.42	-5.85	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.75	-1.25	-11.06	-12.25	-12.71	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-17.00	-1.55	-15.97	-17.09	-16.28	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-28.10	-1.00	-27.67	-28.67	-28.71	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-31.00	-0.50	-31.02	-32.41	-31.91	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-33.45	-0.20	-33.29	-33.66	-34.81	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-63.25	-1.00
-66.50	-1.25
-66.25	-1.50
-63.25	-1.75
-58.25	-1.75
-54.00	-3.25
-48.50	-4.00
-43.00	-4.00

CRS

USD/KRW 1126.40 (+5.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8900	-2.00	1.3900	0.7650	1*2Y	8.00	0.00
1.5Y	0.9250	-2.00	1.2600	0.8100	2*3Y	10.50	0.00
2Y	0.9700	-2.00	1.2250	0.7950	2*5Y	29.50	-1.50
3Y	1.0750	-2.00	1.3150	0.7350	3*4Y	10.50	0.00
4Y	1.1800	-2.00	1.3750	0.6900	3*5Y	19.00	-1.50
5Y	1.2650	-3.50	1.4350	0.6600	4*5Y	8.50	-1.50
7Y	1.3800	-4.00	1.4500	0.6550	5*7Y	11.50	-0.50
10Y	1.5150	-4.00	1.9050	0.6300	5*10Y	25.00	-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	1.3174	-1.61	1.3335	1.3377	1.3338	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1362	-2.09	2.1571	2.1676	2.1991	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	-0.3896	-2.31	-0.3665	-0.3593	-0.3932	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.1188	-2.59	-0.0929	-0.0844	-0.0929	0.4740	-0.1282	0.4740	-1.2400

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	31.25	0.50	30.75	31.00	31.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	54.80	-0.20	55.00	55.50	56.50	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	81.88	-0.48	82.36	82.99	86.53	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M	42.25	ODD Tenor	
09M			
01Y	52.25 / 52.5		
1.5Y	59		
02Y		SPRD	4*8Y 13.25
03Y	71		10*20Y 6.75
04Y			
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3Y 08 4Y 18		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	98 건	51	47	102	87	63	60	52
금 액	27,140 억원	19,000	8,140	28,568	24,464	15,262	25,190	11,940

장중동향

국고채 금리, 북한 미사일 발사 등 영향으로 소폭 상승 마감. 다만 초장기물은 국고 30년물 입찰 호조로 금리 하락.
(국고채 30년물, 1조 4500억원, 2.365% 낙찰)

IRS, 단기구간을 중심으로 오퍼가 강해지면서 금리 하락.
시중은행이 민평보다 낮게 CD를 발행해 오전 CD가 1bp 낮게 고시되면서 IRS 단기 테너 오퍼가 우세.
현물금리가 초장기물을 제외하고 모두 상승했고, IRS 금리는 하락하면서 본드스왑 역전폭 확대.
CRS, 전구간 하락 마감.
현대캐피탈 발행 관련 부채스왑 부담이 줄어들면서 에셋스왑 물량이 좀 더 적극적으로 나온 영향으로 추측.