IPS Daily Morning Brief

2017-08-31

종가 기준일 2017-08-30

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4150	-1.00	1.4290	1.4309	1.4160	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4600	-1.75	1.4810	1.4788	1.4594	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5075	-1.50	1.5265	1.5230	1.5008	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5725	-1.75	1.5940	1.5905	1.5611	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6200	-1.25	1.6375	1.6393	1.6052	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6950	-1.25	1.7130	1.7219	1.6793	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7500	-1.25	1.7675	1.7769	1.7311	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7925	-1.25	1.8105	1.8201	1.7743	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8525	-1.25	1.8690	1.8808	1.8335	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9300	-1.50	1.9490	1.9669	1.9198	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9600	-1.50	1.9795	1.9981	1.9507	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9775	-1.50	1.9965	2.0109	1.9574	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9950	-1.75	2.0195	2.0321	1.9695	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	4.50	-0.75	5.20	4.79	4.34	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.75	0.25	4.55	4.43	4.14	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	11.25	0.25	11.10	11.63	10.44	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.50	0.00	7.55	8.26	7.41	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.00	0.00	13.00	13.76	12.60	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.25	0.00	17.30	18.09	16.91	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.00	5.45	5.50	5.18	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	0.00	9.75	9.83	9.50	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.00	4.30	4.33	4.32	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.00	0.00	5.85	6.06	5.92	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.75	-0.25	13.85	14.68	14.55	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.75	-0.25	8.00	8.61	8.64	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.05	3.13	3.08	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.75	4.40	3.76	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	6.50	-0.25	7.05	6.53	4.97	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.487	-1.70	1.499	1.483	1.453	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.612	-2.30	1.633	1.627	1.580	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.687	-2.00	1.704	1.701	1.660	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.750	-2.00	1.766	1.786	1.738	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.862	-1.80	1.877	1.899	1.858	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.960	-1.50	1.971	1.991	1.937	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.137	-0.90	2.146	2.168	2.120	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.250	-0.50	2.260	2.291	2.238	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.335	-1.20	2.354	2.368	2.316	2.430	1.430	3.943	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.27	0.05	109.24	109.31	109.23
LKTB	124.45	0.10	124.40	124.57	124.35

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	2.05	0.20	2.77	4.03	4.82	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-3.95	0.55	-3.88	-3.61	-1.86	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-6.70	0.75	-6.61	-6.15	-5.49	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.50	0.75	-5.34	-6.42	-5.83	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.20	0.55	-10.97	-12.21	-12.64	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-16.75	0.25	-16.03	-17.08	-16.26	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-28.45	-0.35	-27.68	-28.71	-28.66	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-32.00	-1.00	-31.08	-32.41	-31.86	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-34.00	-0.55	-33.49	-33.57	-34.67	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-61.75	1.50
-65.25	1.25
-66.00	0.25
-63.50	-0.25
-58.50	-0.25
-54.75	-0.75
-49.75	-1.25
-44.00	-1.00

CRS

USD/KRW 1124.20 (-2.20)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8900	0.00	1.3900	0.7650	1*2Y	7.00	-1.00
1.5Y	0.9200	-0.50	1.2600	0.8100	2*3Y	10.00	-0.50
2Y	0.9600	-1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	28.50	-1.00
3Y	1.0600	-1.50	1.3150	0.7350	3*4Y	10.50	0.00
4Y	1.1650	-1.50	1.3750	0.6900	3*5Y	18.50	-0.50
5Y	1.2450	-2.00	1.4350	0.6600	4*5Y	8.00	-0.50
7Y	1.3550	-2.50	1.4500	0.6550	5*7Y	11.00	-0.50
10Y	1.4900	-2.50	1.9050	0.6300	5*10Y	24.50	-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	1.3294	1.2	1.3174	1.3335	1.3377	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1336	-0.26	2.1362	2.1571	2.1676	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	-0.3576	3.2	-0.3896	-0.3665	-0.3593	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.1164	0.24	-0.1188	-0.0929	-0.0844	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	31.00	-0.25	31.25	30.75	31.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	56.30	1.50	54.80	55.00	55.50	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	80.42	-1.46	81.88	82.36	82.99	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	41.75	ODD Tenor	
09M			
01Y	50.75 / 51		
1.5Y	57.25 / 57.5		
02Y	61.75 / 62	SPRD	1*3Y 18.25
03Y	69.25 / 69.5 / 70		
04Y	74.75		
05Y	78.75 / 79		
07Y			
10Y	92.75 / 93		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	4Y 17.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	108 건	10	98	47	102	87	63	60
금 액	32,995 억원	5,855	27,140	8,140	28,568	24,464	15,262	25,190

장중동향

국고채 금리, 금통위 대기하면서 기준금리 인상 유보 시그널 기대에 금리 하락.

IRS, 금통위 대기하면서 국채선물 흐름에 연동되어 금리 하락.
1년 이하 단기테너로 오퍼가 강하게 나옴. 금통위를 하루 앞두고 금리 하락 베팅이 우세한 모습.

CRS, 1년을 제외하고 전 구간에서 장기 테너를 중심으로 금리 하락.
4-5년 구간을 중심으로 에셋스왑과 부채스왑 물량이 나와 거래 체결.