

IPS Daily Morning Brief

2017-06-28

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4050	-0.25	1.4065	1.3998	1.4173	1.6275	1.2875	2.7850	1.2875
9M	1.4425	-0.25	1.4445	1.4290	1.4416	1.5975	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4825	-0.25	1.4845	1.4618	1.4663	1.5875	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5425	-0.25	1.5415	1.5076	1.5087	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5725	-0.25	1.5715	1.5404	1.5433	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6250	0.00	1.6235	1.5995	1.6079	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6625	0.00	1.6620	1.6451	1.6585	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.6900	-0.25	1.6920	1.6838	1.7044	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7300	-0.50	1.7365	1.7425	1.7748	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8025	-0.50	1.8090	1.8291	1.8708	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.8325	-0.50	1.8395	1.8640	1.9078	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.8325	-0.50	1.8395	1.8704	1.9131	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.8325	-0.50	1.8395	1.8736	1.9121	2.0500	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	3.75	0.00	3.80	2.93	2.43	4.00	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	4.00	0.00	4.00	3.28	2.47	4.00	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	9.00	0.00	8.70	7.86	7.70	9.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	5.25	0.25	5.20	5.91	6.46	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	9.00	0.25	9.05	10.48	11.53	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	11.75	0.00	12.05	14.34	16.11	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	3.75	0.00	3.85	4.56	5.07	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	6.50	-0.25	6.85	8.43	9.65	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	2.75	-0.25	3.00	3.86	4.59	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.00	-0.25	4.45	5.88	7.04	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	11.25	-0.25	11.70	14.54	16.64	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.25	0.00	7.25	8.66	9.60	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.05	3.49	3.69	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.00	3.05	4.13	4.23	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.00	0.00	3.05	4.45	4.13	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.450	0.00	1.446	1.437	1.451	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.562	-1.00	1.569	1.548	1.542	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.635	0.00	1.636	1.609	1.608	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.677	-0.80	1.688	1.665	1.676	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.790	0.10	1.793	1.788	1.800	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.850	-0.20	1.857	1.858	1.872	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.025	-0.40	2.033	2.051	2.082	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.115	-0.70	2.127	2.166	2.198	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.200	0.30	2.210	2.273	2.317	2.430	1.430	3.943	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.40	0.01	109.41	109.43	109.34
LKTb	125.63	0.08	125.63	125.63	125.47

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	3.25	-0.25	3.85	2.47	1.55	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-1.95	0.75	-2.75	-4.08	-3.38	-0.10	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-6.25	-0.25	-6.45	-6.86	-6.51	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-5.20	0.80	-6.43	-6.58	-6.80	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.75	-0.10	-13.08	-14.24	-14.16	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-16.00	-0.05	-16.52	-17.47	-16.80	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-29.50	-0.10	-29.61	-30.82	-30.76	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-31.25	0.20	-31.84	-33.64	-32.70	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-36.75	-0.80	-37.01	-39.89	-40.50	-13.95	-48.50	7.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1136.90	(-0.20)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-64.25	0.25	1Y	0.8400	0.00	1.4000	0.7650	1*2Y	11.00	-1.00		
-65.75	-0.25	1.5Y	0.8850	-0.50	1.2850	0.8100	2*3Y	8.00	0.50		
-62.25	-0.75	2Y	0.9500	-1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	18.50	0.50		
-59.50	-0.50	3Y	1.0300	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	6.50	0.00		
-56.75	-0.50	4Y	1.0950	-0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	10.50	0.00		
-55.50	-0.25	5Y	1.1350	-0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	4.00	0.00		
-56.00	0.00	7Y	1.1700	-0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	3.50	0.00		
-53.75	0.00	10Y	1.2650	-0.50	1.9050	0.6300	5*10Y	13.00	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	1.3768	4.04	1.3364	1.3528	1.3483	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2097	6.99	2.1398	2.1451	2.1505	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	-0.2582	4.04	-0.2986	-0.2822	-0.2967	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0947	-7.69	-0.0178	-0.0151	-0.0155	0.1370	-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	23.00	-0.25	23.25	23.75	23.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	48.00	-0.70	48.70	49.50	49.00	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	83.29	2.95	80.34	79.23	80.22	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY DEAL LEVEL									
IRS	Lv.				ODD Tenor				
06M									
09M	44.25								
01Y	48.5								
1.5Y									
02Y	56.75 / 57 / 57.25 / 57.5 / 57.75				SPRD	1*2Y	09		
03Y	63					1*3Y	13.5		
04Y	65.5 / 66.25 / 66.5 / 66.75					3*4Y	3.75		
05Y	68.75 / 69.5					7*10Y	7.25		
07Y						7*20Y	10.25		
10Y						10*20Y	03		
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1Y 82.5 / 83								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			71 건	22	49	117	106	88	100
금 액			20,925 억원	11,942	8,983	35,126	23,092	21,894	18,949

장중동향
국고채 금리, 초장기물은 소폭 상승했으나 3년물과 10년물 금리는 소폭 내려 혼조세.

IRS, 금리가 장중 국채선물 움직임에 연동되다가 강보합으로 마감.
장중 외인의 국고 16-2 대규모 매도 이슈에 국채선물이 하락하자 금리가 반등하기도 했지만, 국채선물이 상승 마감하면서 다시 금리 하락으로 제한적인 되돌림 양상을 보임.

CRS, 2년 이상 구간에서 모두 하락 마감. 오전에 프라이싱으로 추정되는 오퍼가 강하게 유입되고 FX스왑도 하락해 금리가 하락. 이후 부채스왑 물량이 유입되며 하락폭은 제한.