

IPS Daily Morning Brief

2017-06-30

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4125	-0.25	1.4090	1.4016	1.4158	1.6275	1.2875	2.7825	1.2875
9M	1.4550	0.00	1.4485	1.4325	1.4410	1.5975	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4975	0.00	1.4895	1.4668	1.4665	1.5875	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5625	0.00	1.5510	1.5146	1.5100	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5950	-0.25	1.5825	1.5468	1.5446	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6600	-0.25	1.6385	1.6051	1.6092	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7100	0.25	1.6810	1.6501	1.6596	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7475	0.50	1.7130	1.6875	1.7052	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7950	1.00	1.7565	1.7435	1.7745	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8750	1.00	1.8320	1.8279	1.8700	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9050	1.00	1.8620	1.8620	1.9067	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9050	1.00	1.8620	1.8674	1.9120	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9075	1.00	1.8630	1.8704	1.9112	2.0500	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.25	0.25	3.95	3.09	2.52	4.25	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	4.25	0.00	4.10	3.43	2.56	4.25	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	9.75	-0.25	9.30	8.00	7.81	10.00	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	6.50	0.00	5.60	5.84	6.46	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	11.50	0.50	9.85	10.34	11.50	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	15.25	0.75	13.05	14.08	16.05	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.50	4.25	4.50	5.04	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.75	0.75	7.45	8.24	9.60	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.75	0.25	3.20	3.74	4.55	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.75	0.50	4.35	5.60	6.94	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	12.75	0.50	11.90	14.04	16.48	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	0.00	7.55	8.44	9.54	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	3.41	3.68	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.00	3.00	3.95	4.20	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.25	0.00	3.10	4.25	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	1.460	0.00	1.453	1.439	1.450	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.567	-0.90	1.570	1.553	1.544	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.642	-1.50	1.641	1.614	1.610	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.695	-1.00	1.689	1.669	1.677	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.835	-0.50	1.809	1.791	1.802	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.895	-0.50	1.870	1.860	1.874	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.086	0.50	2.051	2.050	2.083	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.192	1.20	2.148	2.161	2.198	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.275	2.30	2.225	2.263	2.316	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	109.27	0.00	109.28	109.31	109.22
LKTB	124.81	-0.14	124.97	125.08	124.69

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	3.75	0.00	3.65	2.82	1.63	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-0.45	0.90	-1.88	-3.83	-3.36	-0.10	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.70	1.25	-5.83	-6.71	-6.55	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-3.50	0.75	-5.09	-6.39	-6.82	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.50	0.75	-12.78	-14.10	-14.24	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-14.75	1.00	-15.74	-17.27	-16.89	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-29.10	0.50	-29.41	-30.60	-30.84	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-31.70	-0.20	-31.58	-33.32	-32.83	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-36.75	-1.30	-36.22	-39.28	-40.44	-13.95	-48.50	7.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1141.10	(-2.90)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-61.75	-0.50	1Y	0.8800	-0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	12.00	1.00	
-62.75	0.50	1.5Y	0.9350	0.50	1.2850	0.8100	2*3Y	10.00	1.00	
-59.50	0.75	2Y	1.0000	0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	21.00	1.00	
-56.00	1.75	3Y	1.1000	1.50	1.3150	0.7350	3*4Y	7.00	0.00	
-54.00	1.25	4Y	1.1700	1.50	1.3750	0.6900	3*5Y	11.00	0.00	
-53.75	1.00	5Y	1.2100	1.50	1.4350	0.6600	4*5Y	4.00	0.00	
-55.50	0.50	7Y	1.2400	1.50	1.4500	0.6550	5*7Y	3.00	0.00	
-54.50	0.50	10Y	1.3300	1.50	1.9050	0.6300	5*10Y	12.00	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	1.3732	2	1.3532	1.3768	1.3364	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2685	3.87	2.2298	2.2097	2.1398	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	-0.2688	3.5	-0.3038	-0.2582	-0.2986	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0765	-2.67	-0.0498	-0.0947	-0.0178	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	28.00	1.25	26.75	23.00	23.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	55.00	2.70	52.30	48.00	48.70	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	89.53	1.87	87.66	83.29	80.34	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY DEAL LEVEL									
IRS	Lv.				ODD Tenor				
06M	41.25								
09M	45.5								
01Y									
1.5Y	56								
02Y	59.75				SPRD	6*9m	4.25		
03Y	66 / 66.25 / 66.5					1*2y	10		
04Y						3*7y	13		
05Y						3*10y	20.25		
07Y						5*8y	7.5		
10Y	87.5								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			133 건	13	120	71	49	117	106
금 액			29,575 억원	-892	30,467	20,925	8,983	35,126	23,092

장중동향

채권은 외국인의 매도 흐름속에서 혼조세 마감. 3년 국채선물은 외국인의 매도와 증권의 매수로 보합으로 마감했고, 10년 국채선물은 하락마감.

IRS는 재료가 부족한 가운데 헤지펀드의 단기 페이가 많았고, 3년이 1.66~1.665 레벨사이에서 거래가 활발. 5년 이상쪽으로 레벨이 상승하며 커브는 소폭 스텝 마감.

CRS는 부채물량 영향으로 상승했고 3년물 중심으로 거래 활발.