

IPS Daily Morning Brief

2017-07-04

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4150	0.25	1.4120	1.4039	1.4143	1.6275	1.2875	2.7775	1.2875
9M	1.4575	0.25	1.4530	1.4370	1.4405	1.5975	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4975	0.00	1.4945	1.4726	1.4670	1.5875	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5625	0.25	1.5580	1.5230	1.5113	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6000	0.50	1.5920	1.5550	1.5460	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6750	1.25	1.6570	1.6139	1.6105	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7350	1.25	1.7075	1.6593	1.6611	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7825	1.75	1.7455	1.6964	1.7065	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8375	1.50	1.7940	1.7505	1.7753	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9250	2.00	1.8745	1.8335	1.8702	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9525	2.00	1.9035	1.8666	1.9067	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9525	2.00	1.9035	1.8710	1.9119	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9625	2.00	1.9085	1.8745	1.9115	2.0500	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.25	0.00	4.10	3.31	2.62	4.25	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	4.00	-0.25	4.15	3.56	2.65	4.25	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	10.25	0.50	9.75	8.24	7.90	10.25	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.50	0.75	6.50	5.89	6.45	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.50	0.75	11.55	10.43	11.51	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.25	1.25	15.35	14.14	16.05	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	6.00	0.00	5.05	4.54	5.06	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.75	0.50	8.85	8.25	9.60	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	0.50	3.80	3.71	4.54	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.50	-0.25	4.85	5.41	6.88	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	14.25	0.25	12.90	13.71	16.37	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.75	0.50	8.05	8.30	9.49	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.90	3.31	3.65	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	2.75	0.00	2.90	3.75	4.17	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	0.00	3.40	4.10	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	1.445	0.00	1.452	1.440	1.450	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.556	0.40	1.563	1.557	1.544	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.642	1.30	1.641	1.619	1.611	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.715	1.50	1.698	1.677	1.679	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.855	1.30	1.832	1.799	1.804	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.917	1.50	1.893	1.866	1.876	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.120	1.70	2.083	2.054	2.085	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.230	1.80	2.186	2.163	2.200	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.332	2.50	2.273	2.261	2.316	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.25	0.01

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.28	-0.02	109.27	109.30	109.25
LKTB	124.45	-0.16	124.47	124.50	124.28

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	5.25	0.00	4.25	3.26	1.74	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	0.65	-0.15	-0.46	-3.36	-3.32	0.80	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.20	-0.80	-4.90	-6.42	-6.55	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-4.00	-0.25	-4.14	-6.27	-6.83	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.00	-0.05	-12.49	-13.94	-14.33	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-13.45	0.25	-14.73	-16.98	-16.99	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-28.25	-0.20	-28.90	-30.37	-30.92	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-30.50	0.20	-31.13	-32.93	-32.95	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-36.95	-0.50	-36.47	-38.69	-40.42	-13.95	-48.50	7.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1146.90	(+2.80)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-59.75	1.00	1Y	0.9000	1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	12.50	0.00		
-60.75	0.75	1.5Y	0.9550	1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	10.50	0.00		
-57.50	0.50	2Y	1.0250	1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	22.00	0.00		
-54.50	-0.25	3Y	1.1300	1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00		
-53.00	-0.25	4Y	1.2050	1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	11.50	0.00		
-53.75	-0.75	5Y	1.2450	1.00	1.4350	0.6600	4*5Y	4.00	0.00		
-56.25	-0.50	7Y	1.2750	1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	3.00	0.00		
-56.00	-1.00	10Y	1.3650	1.00	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	1.4141	2.85	1.3856	1.3732	1.3532	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.3483	4.27	2.3056	2.2685	2.2298	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	-0.2279	1.55	-0.2434	-0.2688	-0.3038	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.1183	-2.47	-0.0936	-0.0765	-0.0498	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	32.50	1.50	31.00	28.00	26.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	58.80	0.50	58.30	55.00	52.30	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	93.42	1.42	92.00	89.53	87.66	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY DEAL LEVEL										
IRS	Lv.			ODD Tenor						
06M										
09M	45.75									
01Y	49.75 / 50									
1.5Y	56.25									
02Y	60 / 60.25									
03Y	67.25 / 67.5			SPRD	1y*3y @ 17.5					
04Y					3y*5y @ 11					
05Y	78.5				3y*7y @ 17					
07Y										
10Y	92.5 / 92.75									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	1.5y @ 97									
TODAY KRX CCP				전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황		54 건		-82	136	133	120	71	49	117
금 액		13,820 억원		-22,666	36,486	29,575	30,467	20,925	8,983	35,126

장종동향

IRS 커브 약세 스티프닝.아침부터 한산한 모습을 보임. 국고채 30년물 입찰을 앞두고 장기물이 부담을 가지면서 소폭 상승 마감.

CRS는 시장을 움직일만한 수급 요인이 적은 가운데 IRS 금리 상승에 키맞추기 정도가 진행 됐음. 전 구간에 걸쳐 1bp씩 오른후 마감.