

IPS Daily Morning Brief

2017-07-05

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4150	0.00	1.4140	1.4051	1.4137	1.6275	1.2875	2.7775	1.2875
9M	1.4625	0.50	1.4570	1.4396	1.4405	1.5975	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5025	0.50	1.4985	1.4760	1.4675	1.5875	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5700	0.75	1.5635	1.5280	1.5123	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6100	1.00	1.5995	1.5605	1.5473	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6900	1.50	1.6700	1.6204	1.6120	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7525	1.75	1.7255	1.6661	1.6628	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8025	2.00	1.7680	1.7035	1.7082	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8625	2.50	1.8205	1.7571	1.7763	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9500	2.50	1.9040	1.8396	1.8713	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9775	2.50	1.9325	1.8723	1.9079	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9775	2.50	1.9325	1.8763	1.9130	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9875	2.50	1.9395	1.8800	1.9128	2.0500	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.75	0.50	4.30	3.45	2.68	4.75	-6.00	4.75	-6.50
9*12M	4.00	0.00	4.15	3.64	2.70	4.25	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	10.75	0.50	10.10	8.45	7.98	10.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	0.50	7.05	5.99	6.48	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.25	0.75	12.60	10.56	11.55	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	19.25	1.00	16.85	14.30	16.10	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	6.25	0.25	5.55	4.58	5.08	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.25	0.50	9.80	8.31	9.62	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.00	0.25	4.25	3.74	4.54	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.00	0.50	5.25	5.36	6.80	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	14.75	0.50	13.60	13.61	16.30	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.75	0.00	8.35	8.25	9.50	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.85	3.26	3.66	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	2.75	0.00	2.85	3.66	4.18	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	0.00	3.55	4.04	4.16	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	1.451	1.441	1.449	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.557	0.10	1.562	1.559	1.545	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.657	1.50	1.645	1.623	1.613	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.737	2.20	1.710	1.683	1.680	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.875	2.00	1.849	1.804	1.806	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.945	2.80	1.912	1.872	1.879	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.154	3.40	2.109	2.060	2.087	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.267	3.70	2.216	2.167	2.202	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.370	3.80	2.307	2.264	2.318	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.26	0.01

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.21	-0.07	109.23	109.24	109.19
LKTB	124.05	-0.40	124.17	124.24	123.34

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	5.75	0.50	4.75	3.53	1.80	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.30	0.65	0.19	-3.06	-3.28	1.30	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.70	-0.50	-4.59	-6.27	-6.55	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-4.70	-0.70	-4.04	-6.22	-6.83	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.25	-0.25	-12.39	-13.83	-14.36	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-14.25	-0.80	-14.38	-16.83	-17.05	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-29.15	-0.90	-28.83	-30.28	-31.04	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-31.70	-1.20	-31.22	-32.78	-33.07	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-38.25	-1.30	-36.77	-38.38	-40.49	-13.95	-48.50	7.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1150.60 (+3.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-61.75	-2.00	1Y	0.8850	-1.50	1.4000	0.7650	1*2Y	11.00	-1.50		
-63.50	-2.75	1.5Y	0.9350	-2.00	1.2850	0.8100	2*3Y	15.50	5.00		
-61.50	-4.00	2Y	0.9950	-3.00	1.2250	0.7950	2*5Y	22.50	0.50		
-54.00	0.50	3Y	1.1500	2.00	1.3150	0.7350	3*4Y	3.00	-4.50		
-57.25	-4.25	4Y	1.1800	-2.50	1.3750	0.6900	3*5Y	7.00	-4.50		
-58.25	-4.50	5Y	1.2200	-2.50	1.4350	0.6600	4*5Y	4.00	0.00		
-61.25	-5.00	7Y	1.2500	-2.50	1.4500	0.6550	5*7Y	3.00	0.00		
-61.00	-5.00	10Y	1.3400	-2.50	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	1.4141	0	1.4141	1.3856	1.3732	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.3483	0.00	2.3483	2.3056	2.2685	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	-0.2429	-1.5	-0.2279	-0.2434	-0.2688	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0813	3.70	-0.1183	-0.0936	-0.0765	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	34.00	1.50	32.50	31.00	28.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	61.00	2.20	58.80	58.30	55.00	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	93.42	0.00	93.42	92.00	89.53	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY DEAL LEVEL										
IRS	Lv.			ODD Tenor	9y 92.75					
06M	41.75									
09M	46.25									
01Y	50.5									
1.5Y										
02Y	60.75 / 61 / 61.25 / 61.5									
03Y	68.5 / 68.75 / 69 / 69.25			SPRD	1*2y		10.5 / 10.75			
04Y	75.75				1*3y		18.5			
05Y	80 / 80.25				2*4y		14			
07Y					3*4y		6.5			
10Y	95.25				3*5y		11.5 / 11.75			
12Y					4*7y		11			
15Y					4*10y		20.25			
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			118 건	64	54	136	133	120	71	49
금 액			32,875 억원	19,055	13,820	36,486	29,575	30,467	20,925	8,983

장종동향

채권은 국고채 30년물 입찰 부진과 북한의 ICBM 발사 성공 발표 등으로 금리 상승 마감. 3년 국채선물은 7틱하락, 10년 국채선물은 40틱 하락하며 글로벌 금리 상승 기조를 이어감.

IRS는 비디시한 분위기에서 2년, 3년 거래가 주를 이뤘고, 커브는 스티프너가 많아 스프레드 오퍼가 많이 나오며 거래.

CRS는 환율과 에셋스왑의 영향을 받으며 하락 마감.