IPS Daily Morning Brief

2017-07-06

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4100	-0.50	1.4130	1.4060	1.4130	1.6250	1.2875	2.7725	1.2875
9M	1.4600	-0.25	1.4580	1.4420	1.4404	1.5950	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5025	0.00	1.4995	1.4794	1.4680	1.5850	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5675	-0.25	1.5645	1.5329	1.5133	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6100	0.00	1.6020	1.5660	1.5485	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6900	0.00	1.6755	1.6271	1.6135	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7525	0.00	1.7345	1.6735	1.6644	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8000	-0.25	1.7795	1.7111	1.7098	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8625	0.00	1.8360	1.7645	1.7778	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9525	0.25	1.9215	1.8469	1.8726	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9800	0.25	1.9495	1.8790	1.9090	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9800	0.25	1.9495	1.8826	1.9141	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9900	0.25	1.9580	1.8866	1.9142	2.0500	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	5.00	0.25	4.50	3.60	2.74	5.00	-6.00	5.00	-6.50
9*12M	4.25	0.25	4.15	3.74	2.75	4.25	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	10.75	0.00	10.25	8.66	8.05	10.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	0.00	7.35	6.11	6.51	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.25	0.00	13.25	10.75	11.60	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	19.00	-0.25	17.75	14.51	16.14	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	6.25	0.00	5.90	4.64	5.09	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.00	-0.25	10.40	8.40	9.63	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	-0.25	4.50	3.76	4.54	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.25	0.25	5.65	5.34	6.79	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.25	0.50	14.20	13.58	16.28	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.00	0.25	8.55	8.24	9.48	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.80	3.21	3.64	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	2.75	0.00	2.80	3.58	4.15	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	0.00	3.65	3.98	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	1.447	0.20	1.448	1.441	1.449	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.562	0.50	1.559	1.560	1.546	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.667	1.00	1.647	1.628	1.614	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.745	0.80	1.718	1.689	1.682	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.882	0.70	1.858	1.811	1.808	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.960	1.50	1.924	1.878	1.881	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.164	1.00	2.125	2.067	2.089	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.277	1.00	2.236	2.173	2.204	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.370	0.00	2.331	2.268	2.320	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.23	-0.03

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.17	-0.04	109.21	109.22	109.17
LKTB	123.95	-0.10	124.05	124.14	123.91

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	5.55	-0.20	5.11	3.79	1.85	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	0.55	-0.75	0.57	-2.72	-3.24	1.30	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-5.70	-1.00	-4.54	-6.15	-6.55	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-5.50	-0.80	-4.29	-6.16	-6.84	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.95	-0.70	-12.33	-13.70	-14.39	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-16.00	-1.75	-14.43	-16.72	-17.12	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-30.15	-1.00	-28.94	-30.21	-31.11	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-32.45	-0.75	-31.41	-32.65	-33.18	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-38.00	0.25	-37.28	-38.14	-40.56	-13.95	-48.50	7.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-62.75	-1.00
-64.25	-0.75
-62.50	-1.00
-59.00	-5.00
-57.75	-0.50
-58.00	0.25
-60.75	0.50
-60.75	0.25

CRS

USD/KRW 1150.50 (-0.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8750	-1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	11.00	0.00
1.5Y	0.9250	-1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	11.50	-4.00
2Y	0.9850	-1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	23.50	1.00
3Y	1.1000	-5.00	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	4.50
4Y	1.1750	-0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	12.00	5.00
5Y	1.2200	0.00	1.4350	0.6600	4*5Y	4.50	0.50
7Y	1.2550	0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	3.50	0.50
10Y	1.3450	0.50	1.9050	0.6300	5*10Y	12.50	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	1.4022	-1.19	1.4141	1.4141	1.3856	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.3251	-2.32	2.3483	2.3483	2.3056	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	-0.2648	-2.19	-0.2429	-0.2279	-0.2434	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0481	3.32	-0.0813	-0.1183	-0.0936	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	34.25	0.25	34.00	32.50	31.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	61.00	0.00	61.00	58.80	58.30	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	92.29	-1.13	93.42	93.42	92.00	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.
06M	
09M	
01Y	50 / 50.25
1.5Y	
02Y	60.25 / 60.5 / 60.75 / 61
03Y	
04Y	74.75
05Y	79.5 / 79.75
07Y	86
10Y	94.25
12Y	
15Y	
20Y	
CRS	2Y 98.5

ODD Tenor

SPRD	
	6*9M 4.75
	9*12M 04
	1*2Y 10.75
	3*4Y 6.25
	7*10Y 8.75
	2*5*10Y 04

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	76 건	-42	118	54	136	133	120	71
금 액	21,645 억원	-11,230	32,875	13,820	36,486	29,575	30,467	20,925

장중동향

IRS, 장기구간만 소폭 상승 마감.
전일 미국 시장이 독립기념일 휴장으로 보합권에서 등락. 거래는 그다지 많지 않고 대체로 잠잠했던 편.
2년 위주로 다수 거래. 60.25(-0.75)에서 61(0.00)까지 거래.

CRS, 단기구간이 에셋스왑 오퍼 영향으로 금리가 하락하면서 커브 스티프닝.