IPS Daily Morning Brief

2017-07-10

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4275	0.50	1.4180	1.4090	1.4121	1.6150	1.2875	2.7600	1.2875
9M	1.4800	1.00	1.4660	1.4480	1.4407	1.5850	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5275	1.50	1.5085	1.4875	1.4692	1.5725	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5925	2.00	1.5730	1.5434	1.5155	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6400	2.50	1.6150	1.5778	1.5509	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7250	3.25	1.6945	1.6411	1.6166	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7925	3.75	1.7575	1.6891	1.6678	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8475	4.50	1.8070	1.7276	1.7131	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.9250	6.00	1.8705	1.7810	1.7805	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	2.0200	6.50	1.9605	1.8633	1.8752	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0475	6.50	1.9880	1.8944	1.9112	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0475	6.50	1.9880	1.8973	1.9162	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0575	6.50	1.9980	1.9016	1.9169	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.25	0.50	4.80	3.90	2.85	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.75	0.50	4.25	3.95	2.85	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.25	1.00	10.65	9.03	8.17	11.25	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.50	0.75	7.95	6.34	6.57	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	15.25	1.25	14.25	11.14	11.68	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	20.75	2.00	19.20	14.99	16.22	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	6.75	0.50	6.30	4.80	5.12	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	12.25	1.25	11.25	8.65	9.65	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.50	0.75	4.95	3.85	4.54	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.75	1.50	6.35	5.34	6.74	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	17.25	2.00	15.35	13.56	16.21	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.50	0.50	9.00	8.23	9.47	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	3.11	3.60	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	2.75	0.00	2.75	3.40	4.10	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	0.00	3.75	3.84	4.17	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.448	0.10	1.446	1.443	1.449	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.578	1.10	1.564	1.564	1.547	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.687	1.50	1.665	1.637	1.617	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.777	2.50	1.745	1.702	1.685	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.915	2.30	1.884	1.823	1.812	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.997	2.20	1.959	1.892	1.885	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.201	2.80	2.162	2.081	2.092	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.317	3.50	2.275	2.186	2.208	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.375	0.80	2.363	2.276	2.323	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.39	0.00
CALL	1.23	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.04	-0.11	109.10	109.11	109.04
LKTB	123.52	-0.42	123.74	123.72	123.46

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	7.95	1.40	6.21	4.41	1.98	7.95	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.45	0.90	0.90	-2.07	-3.16	1.45	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.70	1.00	-5.00	-5.89	-6.59	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-5.20	0.75	-5.07	-6.08	-6.82	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.25	1.45	-12.63	-13.39	-14.39	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-14.95	2.30	-15.18	-16.42	-17.16	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-27.60	3.20	-29.19	-29.97	-31.16	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-29.70	3.00	-31.41	-32.30	-33.28	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-31.75	5.70	-36.48	-37.46	-40.58	-13.95	-48.50	7.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-59.75	3.00
-60.75	2.50
-59.00	2.00
-55.50	1.75
-54.75	1.25
-54.75	1.50
-59.00	0.00
-59.50	-0.50

CRS

USD/KRW 1154.30 (-3.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9300	4.50	1.4000	0.7650	1*2Y	12.00	0.00
1.5Y	0.9850	4.50	1.2850	0.8100	2*3Y	12.00	0.50
2Y	1.0500	4.50	1.2250	0.7950	2*5Y	25.00	1.50
3Y	1.1700	5.00	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00
4Y	1.2450	5.00	1.3750	0.6900	3*5Y	13.00	1.00
5Y	1.3000	6.00	1.4350	0.6600	4*5Y	5.50	1.00
7Y	1.3350	6.00	1.4500	0.6550	5*7Y	3.50	0.00
10Y	1.4250	6.00	1.9050	0.6300	5*10Y	12.50	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	1.403	0.46	1.3984	1.4022	1.4141	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.3893	2.05	2.3688	2.3251	2.3483	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	-0.2840	-1.04	-0.2736	-0.2648	-0.2429	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0723	1.45	-0.0868	-0.0481	-0.0813	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	38.00	4.00	34.00	34.25	34.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	73.90	2.40	71.50	61.00	61.00	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	98.63	1.59	97.04	92.29	93.42	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	
09M	48 / 48.25		
01Y	52		
1.5Y			
02Y		SPRD	1*2y 10.75
03Y	71 / 71.75		1*3y 19.5
04Y			2*5y 21
05Y	82.5		3*10y 27.5
07Y	91		5*10y 16
10Y	98.5 / 98.75 / 99 / 00 / 01 / 1.25 / 1.5 / 03		10*20y 3.75
12Y			
15Y			
20Y	3.75 / 04		
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	130 건	27	103	76	118	54	136	133
금 액	32,417 억원	-10,243	42,660	21,645	32,875	13,820	36,486	29,575

장중동향

ECB의 통화정책회의 의사록이 매파적인 스탠스를 보이면서 외국인의 국채선물 대거 매도로 채권금리 상승.

IRS는 채권 금리가 상승함에 따른 손절성 미드로 커브가 급격하게 스티프닝 되며 상승. 특히 10년쪽으로 거래가 집중되면서 하루종일 비드가 꾸준히 올라와 거래.

CRS 역시 비드가 꾸준한 모습을 보이며 4.5~6bp정도 레벨이 상승하며 마감.