

IPS Daily Morning Brief

2017-07-11

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4125	-1.50	1.4175	1.4096	1.4115	1.6150	1.2875	2.7600	1.2875
9M	1.4650	-1.50	1.4675	1.4496	1.4406	1.5850	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5100	-1.75	1.5110	1.4898	1.4697	1.5725	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5750	-1.75	1.5755	1.5465	1.5163	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6250	-1.50	1.6200	1.5815	1.5520	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7050	-2.00	1.7005	1.6456	1.6179	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7675	-2.50	1.7640	1.6944	1.6691	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8225	-2.50	1.8150	1.7335	1.7145	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8975	-2.75	1.8825	1.7870	1.7817	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9950	-2.50	1.9745	1.8694	1.8763	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0200	-2.75	2.0015	1.8999	1.9120	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0200	-2.75	2.0015	1.9024	1.9169	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0300	-2.75	2.0115	1.9069	1.9180	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.25	0.00	5.00	4.00	2.92	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.50	-0.25	4.35	4.01	2.90	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.50	0.25	10.90	9.18	8.23	11.50	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	-0.50	8.05	6.41	6.59	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.25	-1.00	14.40	11.29	11.72	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	19.75	-1.00	19.50	15.20	16.25	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	6.25	-0.50	6.35	4.88	5.13	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.75	-0.50	11.45	8.79	9.66	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.50	0.00	5.10	3.91	4.54	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.50	-0.25	6.75	5.35	6.72	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	17.25	0.00	15.95	13.59	16.18	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.75	0.25	9.20	8.24	9.46	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	-0.25	2.70	3.05	3.57	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	2.50	-0.25	2.70	3.30	4.06	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	-0.25	3.70	3.75	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	1.449	0.10	1.447	1.444	1.449	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.576	-0.20	1.568	1.565	1.547	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.665	-2.20	1.670	1.639	1.617	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.752	-2.50	1.753	1.705	1.685	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.885	-3.00	1.890	1.826	1.812	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.962	-3.50	1.968	1.895	1.885	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.166	-3.50	2.172	2.084	2.093	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.282	-3.50	2.285	2.190	2.209	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.345	-3.00	2.365	2.277	2.323	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.39	0.00
CALL	1.24	0.01

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.16	0.12	109.06	109.16	109.04
LKTb	123.90	0.38	123.57	123.90	123.48

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	6.10	-1.85	6.38	4.61	2.05	7.95	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-0.10	-1.55	0.75	-1.84	-3.11	1.45	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.00	0.70	-4.96	-5.74	-6.53	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-4.70	0.50	-5.21	-5.91	-6.75	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.75	0.50	-12.58	-13.15	-14.31	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-13.95	1.00	-15.28	-16.12	-17.08	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-26.85	0.75	-28.91	-29.72	-31.08	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-28.70	1.00	-31.05	-32.02	-33.23	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-31.50	0.25	-35.39	-37.05	-40.46	-13.95	-48.50	7.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1149.50 (-4.80)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-58.00	1.75	1Y	0.9300	0.00	1.4000	0.7650	1*2Y	12.00	0.00	
-59.00	1.75	1.5Y	0.9850	0.00	1.2850	0.8100	2*3Y	11.50	-0.50	
-57.50	1.50	2Y	1.0500	0.00	1.2250	0.7950	2*5Y	24.00	-1.00	
-54.00	1.50	3Y	1.1650	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00	
-52.75	2.00	4Y	1.2400	-0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	12.50	-0.50	
-53.25	1.50	5Y	1.2900	-1.00	1.4350	0.6600	4*5Y	5.00	-0.50	
-57.25	1.75	7Y	1.3250	-1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	3.50	0.00	
-58.00	1.50	10Y	1.4150	-1.00	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	1.3952	-0.78	1.4030	1.3984	1.4022	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.3759	-1.34	2.3893	2.3688	2.3251	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	-0.2698	1.42	-0.2840	-0.2736	-0.2648	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0939	-2.16	-0.0723	-0.0868	-0.0481	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	37.00	-1.00	38.00	34.00	34.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	70.60	-3.30	73.90	71.50	61.00	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	98.07	-0.56	98.63	97.04	92.29	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS	Lv.				ODD Tenor				
06M	42.5								
09M									
01Y	52								
1.5Y	58.5								
02Y					SPRD	1.5*4Y	20.5		
03Y						5*6Y	4.5		
04Y	79					5*10Y	17.5		
05Y						7*12Y	12.5		
07Y									
10Y	1.75 / 02								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	81 건	-49	130	103	76	118	54	136	
금 액	21,840 억원	-10,577	32,417	42,660	21,645	32,875	13,820	36,486	

장종동향

IRS, 금리가 하락. 커브 플랫트닝.
 국고 5년물 입찰호조 & 외인의 3년 국채선물 매도세 약화 등이 채권시장의 전반적인 강세 요인으로 작용. 외인이 입찰에 참여했다는 소문도 채권 강세 자극.
 (국고 5년 0.95조 1.985%에 낙찰...용찰 4.47조)

CRS, 중장기구간 중심으로 하락 마감.