

IPS Daily Morning Brief

2017-07-12

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4150	0.25	1.4175	1.4106	1.4110	1.6100	1.2875	2.7600	1.2875
9M	1.4675	0.25	1.4685	1.4518	1.4408	1.5800	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5125	0.25	1.5130	1.4925	1.4704	1.5700	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5775	0.25	1.5770	1.5503	1.5175	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6275	0.25	1.6235	1.5861	1.5534	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7075	0.25	1.7040	1.6513	1.6198	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7650	-0.25	1.7665	1.7004	1.6711	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8200	-0.25	1.8185	1.7403	1.7165	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8925	-0.50	1.8885	1.7944	1.7835	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9900	-0.50	1.9825	1.8771	1.8781	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0175	-0.25	2.0095	1.9073	1.9136	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0175	-0.25	2.0095	1.9094	1.9185	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0275	-0.25	2.0195	1.9140	1.9198	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.25	0.00	5.10	4.11	2.98	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.50	0.00	4.45	4.08	2.96	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.50	0.00	11.05	9.36	8.30	11.50	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	0.00	8.05	6.51	6.63	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.75	-0.50	14.30	11.43	11.77	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	19.25	-0.50	19.50	15.41	16.31	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	-0.50	6.25	4.91	5.14	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.25	-0.50	11.45	8.90	9.68	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.50	0.00	5.20	3.99	4.54	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.25	-0.25	7.00	5.41	6.70	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	17.00	-0.25	16.40	13.69	16.16	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.75	0.00	9.40	8.28	9.46	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.25	2.70	3.01	3.55	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	2.75	0.25	2.70	3.23	4.03	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	0.25	3.70	3.69	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	1.450	0.10	1.448	1.445	1.449	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.580	0.40	1.573	1.567	1.548	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.672	0.70	1.673	1.643	1.618	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.762	1.00	1.758	1.710	1.687	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.887	0.20	1.892	1.831	1.813	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.962	0.00	1.971	1.900	1.887	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.157	-0.90	2.172	2.089	2.094	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.277	-0.50	2.287	2.195	2.210	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.335	-1.00	2.358	2.280	2.323	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.39	0.00
CALL	1.23	-0.01

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.14	-0.02	109.17	109.17	109.12
LKTb	123.96	0.06	123.92	123.99	123.75

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	6.25	0.15	6.48	4.80	2.14	7.95	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-0.25	-0.15	0.44	-1.63	-3.04	1.45	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.45	-0.45	-4.91	-5.65	-6.49	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-5.45	-0.75	-5.36	-5.89	-6.68	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.20	-0.45	-12.57	-13.05	-14.23	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-14.20	-0.25	-15.27	-15.94	-17.01	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-26.45	0.40	-28.37	-29.48	-31.00	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-28.70	0.00	-30.45	-31.76	-33.17	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-30.75	0.75	-33.89	-36.63	-40.29	-13.95	-48.50	7.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1151.10 (+1.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-59.25	-1.25	1Y	0.9200	-1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	12.00	0.00		
-60.25	-1.25	1.5Y	0.9750	-1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	11.50	0.00		
-58.75	-1.25	2Y	1.0400	-1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	24.00	0.00		
-55.25	-1.25	3Y	1.1550	-1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00		
-53.50	-0.75	4Y	1.2300	-1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	12.50	0.00		
-54.00	-0.75	5Y	1.2800	-1.00	1.4350	0.6600	4*5Y	5.00	0.00		
-57.75	-0.50	7Y	1.3150	-1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	3.50	0.00		
-58.50	-0.50	10Y	1.4050	-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	1.3832	-1.2	1.3952	1.4030	1.3984	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.3643	-1.16	2.3759	2.3893	2.3688	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	-0.2888	-1.9	-0.2698	-0.2840	-0.2736	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0873	0.66	-0.0939	-0.0723	-0.0868	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	36.25	-0.75	37.00	38.00	34.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	69.70	-0.90	70.60	73.90	71.50	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	98.11	0.04	98.07	98.63	97.04	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS	Lv.			ODD Tenor					
06M									
09M									
01Y	51.25								
1.5Y	57.75								
02Y	62.75			SPRD	4*5y @ 5.75				
03Y									
04Y									
05Y	82.25								
07Y									
10Y	99.5 / 99 / 98.75								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	18M @ 97.5								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	74 건		-7	81	130	103	76	118	54
금 액	17,914 억원		-3,926	21,840	32,417	42,660	21,645	32,875	13,820

장중동향

IRS는 전반적으로 조용한 모습을 보임. 금리가 중장기 구간을 중심으로 하락 마감. 10년 국채선물이 강세를 보인 데다 장기 구간을 중심으로 오퍼가 유입되면서 수익률곡선은 평탄화됨.

CRS는 옐런 Fed 의장의 발언을 앞두고 움직임이 제한적이었고 소폭 하락 마감.