

IPS Daily Morning Brief

2017-07-13

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4150	0.00	1.4185	1.4114	1.4108	1.6075	1.2875	2.7600	1.2875
9M	1.4650	-0.25	1.4695	1.4534	1.4411	1.5800	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5075	-0.50	1.5140	1.4946	1.4712	1.5700	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5725	-0.50	1.5780	1.5534	1.5187	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6250	-0.25	1.6265	1.5903	1.5550	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7100	0.25	1.7080	1.6566	1.6217	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7650	0.00	1.7690	1.7063	1.6731	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8175	-0.25	1.8220	1.7469	1.7185	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8875	-0.50	1.8935	1.8019	1.7853	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9825	-0.75	1.9885	1.8851	1.8799	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0100	-0.75	2.0155	1.9149	1.9152	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0125	-0.50	2.0160	1.9168	1.9200	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0225	-0.50	2.0260	1.9215	1.9217	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.00	-0.25	5.10	4.20	3.03	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.25	-0.25	4.45	4.13	3.01	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.75	0.25	11.25	9.56	8.38	11.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.50	0.50	8.15	6.64	6.68	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.00	0.25	14.25	11.60	11.81	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	19.25	0.00	19.55	15.66	16.35	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	-0.25	6.10	4.96	5.14	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.75	-0.50	11.40	9.03	9.68	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.25	-0.25	5.30	4.06	4.54	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.00	-0.25	7.15	5.50	6.68	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	16.50	-0.50	16.65	13.83	16.14	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.50	-0.25	9.50	8.33	9.46	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.70	2.98	3.53	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.25	2.75	3.16	4.01	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	0.25	3.75	3.64	4.18	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	0.00	1.449	1.445	1.449	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.576	-0.40	1.575	1.567	1.548	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.670	-0.20	1.673	1.645	1.619	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.762	0.00	1.761	1.714	1.688	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.885	-0.20	1.893	1.835	1.815	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.960	-0.20	1.971	1.904	1.888	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.150	-0.70	2.169	2.094	2.094	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.275	-0.20	2.287	2.200	2.211	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.325	-1.00	2.349	2.283	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	109.15	0.01	109.17	109.20	109.15
LKTb	124.00	0.04	1274.07	124.19	123.97

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	6.52	4.92	2.24	7.95	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-0.35	-0.10	0.26	-1.41	-2.97	1.45	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.50	-0.05	-4.67	-5.51	-6.45	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-5.20	0.25	-5.30	-5.75	-6.61	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.00	0.20	-12.38	-12.92	-14.16	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-14.25	-0.05	-14.92	-15.73	-16.95	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-26.25	0.20	-27.59	-29.22	-30.91	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-29.25	-0.55	-29.81	-31.52	-33.11	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-30.25	0.50	-32.34	-36.15	-40.12	-13.95	-48.50	7.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1145.20 (-5.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-59.75	-0.50	1Y	0.9100	-1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	12.50	0.50		
-60.75	-0.50	1.5Y	0.9650	-1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	11.50	0.00		
-59.00	-0.25	2Y	1.0350	-0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	24.00	0.00		
-56.00	-0.75	3Y	1.1500	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00		
-54.00	-0.50	4Y	1.2250	-0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	12.50	0.00		
-54.25	-0.25	5Y	1.2750	-0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	5.00	0.00		
-57.75	0.00	7Y	1.3100	-0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	3.50	0.00		
-58.75	-0.25	10Y	1.3950	-1.00	1.9050	0.6300	5*10Y	12.00	-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	1.3470	-3.62	1.3832	1.3952	1.4030	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.3214	-4.29	2.3643	2.3759	2.3893	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	-0.3230	-3.42	-0.2888	-0.2698	-0.2840	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0464	4.09	-0.0873	-0.0939	-0.0723	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	35.75	-0.50	36.25	37.00	38.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	69.90	0.20	69.70	70.60	73.90	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	97.44	-0.67	98.11	98.07	98.63	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		Lv.		ODD Tenor					
06M									
09M	46								
01Y									
1.5Y	57 / 57.25								
02Y	62				10*20y 04				
03Y	70 / 70.25			SPRD					
04Y	75.5								
05Y	80.5 / 80.75 / 81								
07Y									
10Y	97.25 / 97.5								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y 90.5 / 2y 03 / 4y 22.5 / 1*2y 12.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황		81 건	7	74	81	130	103	76	118
금 액		21,155 억원	3,241	17,914	21,840	32,417	42,660	21,645	32,875

장종동향

채권은 금통위와 옐런 발언대기 등으로 관망세를 보이며 강보합으로 마감.

IRS는 채권과 연동되며 0.25bp 정도로 오르내리며 보합권으로 마감. 조용한가운데 간간히 거래가 이루어졌고 오후에 거래가 집중되며 5년쪽으로 활발.

CRS는 에셋영향으로 전구간 하락 마감.