

IPS Daily Morning Brief

2017-07-17

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4150	0.25	1.4140	1.4124	1.4104	1.6075	1.2875	2.7600	1.2875
9M	1.4650	0.25	1.4650	1.4561	1.4418	1.5800	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5100	0.25	1.5095	1.4983	1.4729	1.5700	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5675	0.25	1.5715	1.5583	1.5212	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6175	0.50	1.6215	1.5969	1.5580	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6975	0.50	1.7025	1.6656	1.6253	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7500	0.50	1.7585	1.7168	1.6767	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8000	0.75	1.8105	1.7589	1.7223	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8650	0.50	1.8805	1.8159	1.7886	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9550	0.75	1.9740	1.9000	1.8831	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9850	0.75	2.0020	1.9293	1.9181	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9900	0.75	2.0045	1.9306	1.9229	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0000	0.75	2.0145	1.9364	1.9253	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.00	0.00	5.10	4.38	3.14	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.50	0.00	4.45	4.21	3.12	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	10.75	0.25	11.20	9.86	8.51	11.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	0.00	8.10	6.88	6.73	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.25	0.00	13.70	11.99	11.87	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.25	0.25	18.90	16.20	16.43	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	0.00	5.60	5.11	5.14	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.25	10.80	9.32	9.70	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.00	0.25	5.20	4.21	4.55	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.50	-0.25	7.00	5.70	6.64	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.50	0.00	16.35	14.11	16.09	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.00	0.25	9.35	8.41	9.45	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	2.80	2.93	3.50	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.05	3.06	3.98	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.50	0.00	4.05	3.64	4.22	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.445	0.10	1.448	1.446	1.448	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.565	-0.50	1.573	1.568	1.549	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.657	-0.30	1.665	1.649	1.621	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.745	-0.20	1.754	1.720	1.690	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.867	-0.30	1.879	1.843	1.817	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.940	0.30	1.952	1.912	1.891	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.123	0.20	2.143	2.102	2.096	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.247	0.50	2.265	2.211	2.213	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.297	0.20	2.319	2.289	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	109.23	0.01	109.19	109.23	109.17
LKTb	124.34	-0.08	124.24	124.34	124.13

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	6.50	0.15	6.19	5.18	2.49	7.95	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	0.25	0.75	-0.19	-0.94	-2.81	1.45	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-3.95	0.80	-4.33	-5.24	-6.34	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-4.75	0.70	-5.11	-5.42	-6.49	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.70	0.80	-12.03	-12.64	-14.07	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-14.00	0.45	-14.17	-15.31	-16.85	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-25.80	0.30	-26.29	-28.66	-30.74	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-29.20	0.25	-29.06	-31.06	-33.00	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-29.70	0.55	-30.49	-35.29	-39.77	-13.95	-48.50	6.00	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1133.30 (-3.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-62.00	-1.25	1Y	0.8900	-1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	13.00	0.50		
-62.25	-1.25	1.5Y	0.9450	-1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	11.50	0.00		
-59.75	-1.00	2Y	1.0200	-0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	24.50	0.50		
-56.25	-1.00	3Y	1.1350	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00		
-54.00	-1.00	4Y	1.2100	-0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	13.00	0.50		
-53.50	-0.75	5Y	1.2650	0.00	1.4350	0.6600	4*5Y	5.50	0.50		
-56.50	-0.50	7Y	1.3000	0.00	1.4500	0.6550	5*7Y	3.50	0.00		
-57.00	-0.75	10Y	1.3850	0.00	1.9050	0.6300	5*10Y	12.00	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	1.3597	-1.58	1.3755	1.3470	1.3832	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.3340	-1.17	2.3457	2.3214	2.3643	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	-0.2973	-1.28	-0.2845	-0.3230	-0.2888	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0870	1.67	-0.1037	-0.0464	-0.0873	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	33.75	0.25	33.50	35.75	36.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	68.20	1.00	67.20	69.90	69.70	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	97.43	0.41	97.02	97.44	98.11	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS	Lv.				ODD Tenor				
06M	41.5								
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y					SPRD				
03Y	70								
04Y									
05Y	80.25 / 80								
07Y									
10Y	96.5 / 95.25								
12Y	99.5								
15Y									
20Y	00								
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	37 건		-48	85	81	74	81	130	103
금 액	11,724 억원		-13,131	24,855	21,155	17,914	21,840	32,417	42,660

장중동향

IRS는 조용한 가운데 3년과 5년이 몇번 거래됨. 종가가 나온후 장기를 거래가 몇번 거래되고 전 구간 상승마감. 금통위 재료 등이 해소된 후, 소강상태를 보이며 현·선물 시장에 연동하는 움직임을 보임.

CRS 금리는 단기구간의 에셋스왑프 물량이 나오면서 해당 구간을 중심으로 소폭 강세를 보인후 마감.