

IPS Daily Morning Brief

2017-07-20

종가 기준일 2017-07-19

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4100	-0.50	1.4135	1.4131	1.4099	1.5925	1.2875	2.7600	1.2875
9M	1.4600	-0.50	1.4635	1.4594	1.4429	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5025	-0.50	1.5075	1.5020	1.4756	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5650	-0.25	1.5670	1.5641	1.5253	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6200	0.00	1.6185	1.6063	1.5631	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7000	0.00	1.6995	1.6786	1.6316	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7500	-0.25	1.7525	1.7319	1.6835	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8000	-0.50	1.8035	1.7768	1.7296	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8600	-1.00	1.8680	1.8356	1.7954	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9500	-1.00	1.9575	1.9215	1.8900	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9750	-1.00	1.9845	1.9495	1.9242	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9800	-1.00	1.9895	1.9509	1.9290	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9900	-1.00	1.9995	1.9581	1.9325	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.00	0.00	5.00	4.63	3.30	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.25	0.00	4.40	4.26	3.28	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.75	0.50	11.10	10.43	8.75	11.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	0.00	8.10	7.24	6.85	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.00	-0.25	13.40	12.56	12.03	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.00	-0.50	18.50	17.05	16.65	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	-0.25	5.30	5.33	5.19	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.00	-0.50	10.40	9.81	9.80	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.00	-0.25	5.10	4.49	4.62	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.00	-0.50	6.45	5.89	6.58	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.00	-0.50	15.40	14.48	16.04	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.00	0.00	8.95	8.59	9.46	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.00	2.70	2.80	3.42	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.00	3.20	2.94	3.90	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	0.00	4.20	3.66	4.25	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.440	0.00	1.443	1.448	1.446	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.556	-0.10	1.563	1.567	1.550	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.600	-6.00	1.648	1.652	1.623	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.747	0.00	1.748	1.729	1.694	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.872	0.00	1.873	1.857	1.822	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.945	0.00	1.946	1.927	1.896	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.128	-0.20	2.130	2.117	2.100	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.257	-0.30	2.257	2.229	2.218	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.300	-0.20	2.304	2.300	2.324	2.430	1.430	3.943	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.19	-0.01	109.23	109.25	109.19
LKTb	124.24	0.05	124.45	124.51	124.23

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	-0.50	6.47	5.45	2.93	7.95	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	0.90	-0.15	0.44	-0.28	-2.47	1.45	-19.10	9.75	-19.10
2Y	2.00	6.00	-2.91	-4.62	-6.02	2.00	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-4.70	0.00	-4.81	-5.08	-6.25	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.20	-0.25	-12.01	-12.46	-13.86	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-14.50	-0.50	-14.23	-14.99	-16.64	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-26.80	-0.80	-26.24	-28.10	-30.44	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-30.70	-0.70	-29.97	-30.75	-32.83	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-31.00	-0.80	-30.43	-34.17	-39.19	-13.95	-48.50	6.00	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1120.60 (-2.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-61.25	2.50	1Y	0.8900	2.00	1.4000	0.7650	1*2Y	14.50	-1.00		
-61.50	1.25	1.5Y	0.9500	1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	12.00	0.00		
-58.50	1.00	2Y	1.0350	1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	28.50	0.50		
-54.50	1.00	3Y	1.1550	1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	0.00		
-50.50	1.25	4Y	1.2450	1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	16.50	0.50		
-48.00	2.00	5Y	1.3200	1.50	1.4350	0.6600	4*5Y	7.50	0.50		
-50.00	2.00	7Y	1.3600	1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	4.00	-0.50		
-50.00	2.50	10Y	1.4500	1.50	1.9050	0.6300	5*10Y	13.00	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	1.3601	0.83	1.3518	1.3557	1.3637	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2717	1.15	2.2602	2.3153	2.3349	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	-0.2399	6.83	-0.3082	-0.3053	-0.2933	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0147	-1.45	-0.0002	-0.0353	-0.0879	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	33.00	-1.00	34.00	35.25	33.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	70.10	-0.20	70.30	71.50	68.20	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	91.16	0.32	90.84	95.96	97.12	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS	Lv.				ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y	50.5 / 50.25								
1.5Y	56 / 56.5								
02Y	61.5 / 61.75				SPRD	3*5 @ 10			
03Y	69.75								
04Y									
05Y	79 / 79.75								
07Y	83.25								
10Y	95								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	4y @ 21								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	81 건		26	55	38	37	85	81	74
금 액	13,850 억원		3,590	10,260	11,575	11,724	24,855	21,155	17,914

장종동향

IRS는 오전에 오퍼가 나오다가 국채선물이 보험권까지 하락하자 호가 대치 상황이 나타나는 등 눈치 보기가 이어졌음. 5년이하 거래가 최근 조용했던 장에 비해 활발했던것으로 보이며 초장기물은 오퍼를 찾는 분위기가 이어짐.
IRS 금리는 대부분 구간에서 소폭으로 하락 마감. 금리가 보험권을 벗어나지 못하면서 IRS 역시 방향성을 잃은 모습을 보임.

CRS 금리는 전 구간에 걸쳐 상승. 전일 한국수력원자력 채권 발행 여파가 이어짐.