

IPS Daily Morning Brief

2017-07-27

종가 기준일 2017-07-26

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4025	0.00	1.4055	1.4126	1.4078	1.5925	1.2875	2.7600	1.2875
9M	1.4450	0.00	1.4505	1.4604	1.4425	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4875	0.00	1.4930	1.5035	1.4772	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5475	0.50	1.5505	1.5650	1.5283	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6000	1.00	1.6005	1.6119	1.5675	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6775	1.50	1.6770	1.6900	1.6374	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7300	1.75	1.7275	1.7459	1.6895	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7775	2.00	1.7735	1.7946	1.7359	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8375	2.25	1.8300	1.8569	1.8008	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9275	2.50	1.9185	1.9465	1.8946	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9625	2.50	1.9485	1.9745	1.9278	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9675	2.50	1.9535	1.9771	1.9325	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9800	2.50	1.9655	1.9873	1.9375	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.25	0.00	4.50	4.78	3.47	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.25	0.00	4.25	4.31	3.47	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.25	1.00	10.75	10.84	9.03	11.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.75	0.50	7.65	7.81	6.99	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.00	0.75	12.70	13.40	12.20	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.75	1.00	17.30	18.28	16.85	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	0.25	5.05	5.59	5.21	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.00	0.50	9.65	10.46	9.85	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	0.25	4.60	4.88	4.64	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.00	0.25	5.65	6.23	6.48	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.00	0.50	14.50	15.19	15.87	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.00	0.25	8.85	8.96	9.38	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.00	3.00	2.80	3.32	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	3.50	3.06	3.80	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.00	4.70	4.07	4.30	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.426	0.10	1.431	1.443	1.442	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.537	0.20	1.543	1.560	1.548	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.642	0.50	1.645	1.656	1.626	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.725	1.80	1.722	1.737	1.698	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.845	1.50	1.844	1.867	1.826	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.927	2.20	1.919	1.940	1.901	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.107	2.40	2.098	2.131	2.101	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.240	3.00	2.225	2.251	2.222	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.290	1.90	2.288	2.318	2.322	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	109.30	-0.05	109.28	109.31	109.26
LKTb	124.43	-0.31	124.27	124.49	124.25

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	6.15	-0.10	6.20	6.08	3.49	7.95	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.05	0.30	0.73	0.50	-2.00	1.45	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.20	0.50	-4.41	-4.43	-5.88	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-4.75	-0.30	-4.46	-4.72	-6.01	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.50	0.25	-11.67	-12.10	-13.66	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-14.95	-0.20	-14.51	-14.52	-16.50	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-26.95	-0.15	-26.80	-27.39	-30.06	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-31.25	-0.50	-30.65	-30.46	-32.75	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-31.00	0.60	-32.21	-33.07	-38.46	-13.95	-48.50	6.00	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1121.80 (+6.45)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-59.75	3.00	1Y	0.8900	3.00	1.4000	0.7650	1*2Y	11.50	-0.50		
-61.75	1.50	1.5Y	0.9300	2.00	1.2850	0.8100	2*3Y	9.50	-0.50		
-59.50	1.50	2Y	1.0050	2.50	1.2250	0.7950	2*5Y	23.50	0.50		
-57.75	0.50	3Y	1.1000	2.00	1.3150	0.7350	3*4Y	8.00	0.50		
-55.00	0.75	4Y	1.1800	2.50	1.3750	0.6900	3*5Y	14.00	1.00		
-53.75	1.00	5Y	1.2400	3.00	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	0.50		
-54.25	1.25	7Y	1.2950	3.50	1.4500	0.6550	5*7Y	5.50	0.50		
-52.75	1.00	10Y	1.4000	3.50	1.9050	0.6300	5*10Y	16.00	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	1.3592	-3.07	1.3899	1.3567	1.3443	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2884	-5.00	2.3384	2.2556	2.2370	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	-0.2828	-3.57	-0.2471	-0.2883	-0.3027	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0484	8.00	-0.1284	-0.0356	-0.0170	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	32.75	1.50	31.25	31.25	31.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	70.30	2.80	67.50	67.50	67.20	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	92.92	-1.93	94.85	89.89	89.27	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS	Lv.				ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y	49 / 49.25								
1.5Y									
02Y	60.5				SPRD	2*3Y	7.5		
03Y	68					2*7Y	23.5		
04Y						5*10Y	15 / 15.25		
05Y	77.75 / 78								
07Y									
10Y	93.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	52 건		-32	84	42	62	47	81	55
금 액	12,260 억원		-10,903	23,163	15,630	12,641	9,778	13,850	10,260

장종동향

IRS, 대부분 구간에서 상승. 미 금리 상승을 시초가에 반영했는데 국채선물이 예상보다 세지면서 상승폭이 생각보다 크지 않았음.

CRS 금리도 상승 마감. 뒤쪽 구간으로 상승폭이 더 컸음. 부채 스왑이 있는 것으로 추정.