

IPS Daily Morning Brief

2017-08-02

종가 기준일 2017-08-01

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4100	0.50	1.4055	1.4111	1.4068	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4500	0.50	1.4455	1.4580	1.4422	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4900	0.50	1.4860	1.5009	1.4778	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5500	0.75	1.5445	1.5610	1.5297	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6025	0.75	1.5960	1.6109	1.5700	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6800	1.00	1.6715	1.6896	1.6405	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7375	2.00	1.7225	1.7440	1.6924	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7825	2.25	1.7675	1.7928	1.7383	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8450	2.25	1.8285	1.8563	1.8023	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9350	2.25	1.9185	1.9470	1.8952	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9675	2.25	1.9515	1.9759	1.9279	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9725	2.25	1.9565	1.9795	1.9327	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9850	2.25	1.9690	1.9905	1.9386	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.00	0.00	4.00	4.69	3.54	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.00	0.00	4.05	4.29	3.55	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.25	0.25	11.00	11.00	9.22	11.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.75	0.25	7.55	7.88	7.05	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.50	1.25	12.65	13.31	12.25	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.00	1.50	17.15	18.19	16.84	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	1.00	5.10	5.44	5.20	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	1.25	9.60	10.31	9.79	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.25	4.50	4.88	4.59	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.25	0.00	6.10	6.35	6.40	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.25	0.00	15.10	15.43	15.68	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.00	0.00	9.00	9.08	9.28	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.30	2.89	3.27	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	0.00	3.80	3.25	3.75	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.00	0.00	5.05	4.35	4.35	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.410	-0.20	1.416	1.436	1.440	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.526	0.30	1.528	1.554	1.548	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.635	0.80	1.632	1.654	1.628	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.730	1.00	1.720	1.739	1.700	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.855	1.50	1.841	1.865	1.829	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.950	2.50	1.926	1.942	1.904	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.126	2.70	2.103	2.128	2.102	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.260	3.30	2.234	2.253	2.224	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.336	3.60	2.301	2.315	2.320	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	109.30	-0.05	109.34	109.34	109.30
LKTb	124.25	-0.33	124.50	124.50	124.20

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	8.00	0.70	7.02	6.52	3.79	8.00	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	2.40	0.45	1.67	0.75	-1.79	2.40	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-3.25	-0.05	-3.58	-4.27	-5.82	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-5.00	0.00	-4.89	-4.90	-5.99	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.75	0.50	-11.89	-12.06	-13.63	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-16.75	-0.25	-15.83	-14.93	-16.59	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-28.10	-0.45	-27.43	-27.18	-29.95	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-32.50	-1.05	-31.53	-30.55	-32.85	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-35.10	-1.35	-33.22	-32.40	-38.13	-13.95	-48.50	4.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1121.30 (+2.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-60.00	-0.50	1Y	0.8900	0.00	1.4000	0.7650	1*2Y	11.00	0.00	
-62.00	-0.75	1.5Y	0.9300	0.00	1.2850	0.8100	2*3Y	9.50	-0.50	
-60.25	-0.75	2Y	1.0000	0.00	1.2250	0.7950	2*5Y	25.50	-0.50	
-58.50	-1.50	3Y	1.0950	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	0.00	
-55.25	-2.50	4Y	1.1850	-0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	16.00	0.00	
-52.75	-2.75	5Y	1.2550	-0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	7.00	0.00	
-53.50	-2.75	7Y	1.3100	-0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	5.50	0.00	
-51.00	-2.75	10Y	1.4250	-0.50	1.9050	0.6300	5*10Y	17.00	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	1.3471	-0.8	1.3551	1.3512	1.3671	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2553	-4.19	2.2972	2.2927	2.3187	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	-0.2879	-1.6	-0.2719	-0.2788	-0.2579	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	0.0047	7.49	-0.0702	-0.0677	-0.1017	0.1150	-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	33.25	1.50	31.75	31.75	31.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	73.40	3.00	70.40	69.90	69.00	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	90.82	-3.39	94.21	94.15	95.16	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS	Lv.			ODD Tenor	6y @ 81.5					
06M	41									
09M										
01Y										
1.5Y	55									
02Y	60.25									
03Y	68									
04Y	73.5 73.75									
05Y	77.75			SPRD						
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	78 건		58	20	69	62	52	84	42	
금 액	25,958 억원		21,098	4,860	14,665	15,553	12,260	23,163	15,630	

장중동향

IRS는 장기구간을 중심으로 상승마감. 장초반에는 비드가 우위를 보이는 모습을 보였으나 조용한 분위기를 유지함. 단기쪽 스프레드 거래가 종종 거래됨. 오후들어 4년과 5년을 중심으로 거래가 활발했던것으로 보임.

CRS는 한산한 모습을 보이다가 중기구간 이상을 중심으로 소폭 하락 마감.