

IPS Daily Morning Brief

2017-08-03

종가 기준일 2017-08-02

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4075	-0.25	1.4065	1.4110	1.4065	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4475	-0.25	1.4460	1.4574	1.4422	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4850	-0.50	1.4855	1.5000	1.4778	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5475	-0.25	1.5445	1.5600	1.5300	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5975	-0.50	1.5955	1.6103	1.5705	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6750	-0.50	1.6710	1.6889	1.6410	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7325	-0.50	1.7230	1.7430	1.6930	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7775	-0.50	1.7675	1.7916	1.7388	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8400	-0.50	1.8290	1.8551	1.8025	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9275	-0.75	1.9185	1.9458	1.8951	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9600	-0.75	1.9510	1.9749	1.9277	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9650	-0.75	1.9560	1.9788	1.9325	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9775	-0.75	1.9685	1.9899	1.9387	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.00	0.00	3.95	4.64	3.56	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	3.75	-0.25	3.95	4.26	3.56	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.25	0.00	11.00	11.03	9.27	11.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.75	0.00	7.55	7.86	7.06	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.50	0.00	12.75	13.28	12.26	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.00	0.00	17.20	18.14	16.84	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	0.00	5.20	5.41	5.20	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.00	9.65	10.28	9.78	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.45	4.86	4.58	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.25	0.00	6.15	6.35	6.37	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.00	-0.25	15.10	15.41	15.63	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.75	-0.25	8.95	9.06	9.25	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	2.91	3.26	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	0.00	3.75	3.30	3.74	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.00	0.00	5.00	4.41	4.36	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.404	-0.60	1.411	1.434	1.439	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.545	1.90	1.529	1.553	1.548	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.637	0.20	1.631	1.652	1.628	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.730	0.00	1.721	1.738	1.701	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.852	-0.30	1.843	1.863	1.829	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.947	-0.30	1.930	1.941	1.905	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.118	-0.80	2.105	2.126	2.102	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.247	-1.30	2.235	2.251	2.224	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.335	-0.10	2.310	2.313	2.319	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	109.32	0.02	109.34	109.34	109.31
LKTb	124.38	0.13	124.42	124.46	124.32

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	8.10	0.10	7.41	6.65	3.86	8.10	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	0.25	-2.15	1.51	0.74	-1.76	2.40	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-3.95	-0.70	-3.53	-4.18	-5.79	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-5.50	-0.50	-5.04	-4.90	-5.98	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.95	-0.20	-11.98	-12.01	-13.60	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-16.95	-0.20	-16.23	-14.97	-16.59	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-27.80	0.30	-27.60	-27.06	-29.93	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-31.95	0.55	-31.67	-30.53	-32.87	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-35.75	-0.65	-34.17	-32.29	-38.07	-13.95	-48.50	4.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1123.95 (+2.65)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-60.00	0.00	1Y	0.8850	-0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	11.00	0.00	
-62.25	-0.25	1.5Y	0.9250	-0.50	1.2850	0.8100	2*3Y	9.50	0.00	
-60.25	0.00	2Y	0.9950	-0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	26.00	0.50	
-58.50	0.00	3Y	1.0900	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	9.50	0.50	
-54.75	0.50	4Y	1.1850	0.00	1.3750	0.6900	3*5Y	16.50	0.50	
-52.25	0.50	5Y	1.2550	0.00	1.4350	0.6600	4*5Y	7.00	0.00	
-53.50	0.00	7Y	1.3050	-0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	5.00	-0.50	
-50.75	0.25	10Y	1.4200	-0.50	1.9050	0.6300	5*10Y	16.50	-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	1.3550	0.79	1.3471	1.3551	1.3512	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2686	1.33	2.2553	2.2972	2.2927	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	-0.2820	0.59	-0.2879	-0.2719	-0.2788	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0216	-2.63	0.0047	-0.0702	-0.0677	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	33.00	-0.25	33.25	31.75	31.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	70.20	-3.20	73.40	70.40	69.90	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	91.36	0.54	90.82	94.21	94.15	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS	Lv.				ODD Tenor	13y 96.25			
06M									
09M	44.75								
01Y	48.75								
1.5Y									
02Y									
03Y	67.5 / 68								
04Y					SPRD				
05Y	77.75								
07Y									
10Y	92.75 / 93								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y 09								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	67 건		-11	78	20	69	62	52	84
금 액	15,006 억원		-10,952	25,958	4,860	14,665	15,553	12,260	23,163

장종동향

채권은 외국인의 10년 순매수가 시장을 강제로 이끌면서 금리 하락 마감.

IRS는 채권과 연동하며 레벨이 하락했고 10년쪽으로 강해지며 커브 플랫 마감. 오전부터 10년쪽 가격이 모이면서 3*10년 5*10년 스프레드와 3년,5년 거래가 많은 모습.

CRS는 4년과 5년을 제외하고 전체적으로 레벨 하락마감.