

IPS Daily Morning Brief

2017-08-04

종가 기준일 2017-08-03

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4100	0.25	1.4075	1.4104	1.4062	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4500	0.25	1.4475	1.4564	1.4419	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4875	0.25	1.4865	1.4988	1.4776	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5500	0.25	1.5465	1.5589	1.5300	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6000	0.25	1.5980	1.6095	1.5705	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6775	0.25	1.6745	1.6881	1.6411	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7350	0.25	1.7280	1.7420	1.6931	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7825	0.50	1.7730	1.7906	1.7387	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8450	0.50	1.8350	1.8541	1.8020	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9325	0.50	1.9240	1.9446	1.8941	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9650	0.50	1.9565	1.9740	1.9266	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9700	0.50	1.9615	1.9781	1.9315	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9850	0.75	1.9745	1.9895	1.9380	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.00	0.00	4.00	4.60	3.58	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	3.75	0.00	3.90	4.24	3.57	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.25	0.00	11.15	11.08	9.29	11.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.75	0.00	7.65	7.86	7.05	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.50	0.00	13.00	13.25	12.25	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.25	0.25	17.50	18.11	16.82	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	0.00	5.35	5.39	5.20	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.50	0.25	9.85	10.25	9.76	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	0.25	4.50	4.86	4.56	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.25	0.00	6.20	6.35	6.33	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.00	0.00	15.10	15.40	15.54	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.75	0.00	8.90	9.05	9.20	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	2.94	3.25	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	0.00	3.75	3.35	3.74	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.25	5.05	4.49	4.39	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.400	-0.40	1.408	1.431	1.438	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.542	-0.30	1.532	1.551	1.547	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.637	0.00	1.633	1.650	1.628	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.736	0.60	1.726	1.737	1.701	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.857	0.50	1.848	1.861	1.829	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.951	0.40	1.939	1.940	1.905	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.124	0.60	2.113	2.123	2.101	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.252	0.50	2.242	2.250	2.223	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.335	0.00	2.320	2.311	2.318	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.39	0.00
CALL	1.21	-0.03

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.30	-0.02	109.32	109.33	109.28
LKTb	124.33	-0.05	124.37	124.44	124.28

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	8.75	0.65	7.83	6.76	3.94	8.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	0.80	0.55	1.41	0.75	-1.75	2.40	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-3.70	0.25	-3.52	-4.08	-5.76	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-5.85	-0.35	-5.17	-4.90	-5.98	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.20	-0.25	-12.02	-11.94	-13.57	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-16.85	0.10	-16.56	-14.95	-16.60	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-27.90	-0.10	-27.76	-26.91	-29.89	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-31.95	0.00	-31.82	-30.49	-32.89	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-35.00	0.75	-34.57	-32.17	-38.01	-13.95	-48.50	4.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1128.80 (+4.85)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-59.25	0.75	1Y	0.8950	1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	10.50	-0.50	
-61.50	0.75	1.5Y	0.9350	1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	9.50	0.00	
-60.00	0.25	2Y	1.0000	0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	26.00	0.00	
-58.25	0.25	3Y	1.0950	0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	9.50	0.00	
-54.50	0.25	4Y	1.1900	0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	16.50	0.00	
-52.25	0.00	5Y	1.2600	0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	7.00	0.00	
-53.50	0.00	7Y	1.3100	0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	5.00	0.00	
-50.75	0.00	10Y	1.4250	0.50	1.9050	0.6300	5*10Y	16.50	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	1.3390	-1.6	1.3550	1.3471	1.3551	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2241	-4.45	2.2686	2.2553	2.2972	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	-0.2980	-1.6	-0.2820	-0.2879	-0.2719	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	0.0279	4.95	-0.0216	0.0047	-0.0702	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	0.25	33.00	33.25	31.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	71.00	0.80	70.20	73.40	70.40	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	88.51	-2.85	91.36	90.82	94.21	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS	Lv.				ODD Tenor	13y 96.75				
06M	40.75									
09M	44.75									
01Y	48.5									
1.5Y	54.75 / 55									
02Y	59.75 / 60									
03Y	67.5 / 67.75					2*3y 7.75				
04Y	73.5					3*5y 10.5				
05Y	78					5*10y 15				
07Y					SPRD					
10Y	92.5 / 92.75 / 93.5									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	4*7y 12									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			66 건	-1	67	78	20	69	62	52
금 액			17,855 억원	2,849	15,006	25,958	4,860	14,665	15,553	12,260

장종동향

채권은 미국금리상승을 반영하며 약보합출발, 특별한 재료없이 등락을 거듭하며 약보합 마감. 금리 소폭상승.

IRS는 오전 4년쪽을 중심으로 거래를 시작, 어제에 이어 10년과 13년등 장기물 거래가 눈에 땀. 국채선물과 연동하며 레벨은 소폭상승, 커브는 소폭 스틱마감.

CRS는 비드가 우위를 보이는 가운데 소폭 상승.