

IPS Daily Morning Brief

2017-08-07

종가 기준일 2017-08-04

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4100	0.00	1.4085	1.4095	1.4059	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4500	0.00	1.4485	1.4549	1.4418	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4875	0.00	1.4870	1.4968	1.4776	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5500	0.00	1.5480	1.5568	1.5302	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5975	-0.25	1.5985	1.6074	1.5708	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6750	-0.25	1.6755	1.6856	1.6412	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7300	-0.50	1.7305	1.7389	1.6931	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7775	-0.50	1.7760	1.7871	1.7386	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8400	-0.50	1.8385	1.8499	1.8015	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9275	-0.50	1.9270	1.9400	1.8931	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9600	-0.50	1.9595	1.9696	1.9256	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9675	-0.25	1.9650	1.9741	1.9306	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9850	0.00	1.9790	1.9859	1.9374	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.00	0.00	4.00	4.54	3.59	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	3.75	0.00	3.85	4.19	3.58	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.00	-0.25	11.15	11.06	9.31	11.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.75	0.00	7.70	7.83	7.05	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.25	-0.25	13.20	13.15	12.24	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.00	-0.25	17.75	17.98	16.78	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	-0.25	5.50	5.33	5.19	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	-0.25	10.05	10.15	9.74	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	0.00	4.55	4.83	4.55	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.25	0.00	6.25	6.28	6.30	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.00	0.00	15.10	15.29	15.45	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.75	0.00	8.85	9.01	9.16	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	2.96	3.25	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.25	3.80	3.41	3.75	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.75	0.50	5.20	4.59	4.43	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.405	0.50	1.406	1.429	1.437	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.542	0.00	1.536	1.550	1.547	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.639	0.20	1.635	1.648	1.628	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.742	0.60	1.732	1.735	1.701	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.857	0.00	1.852	1.858	1.829	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.947	-0.40	1.944	1.938	1.905	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.125	0.10	2.118	2.119	2.100	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.252	0.00	2.248	2.246	2.222	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.345	1.00	2.330	2.310	2.317	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.39	0.00
CALL	1.22	0.01

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.31	0.01	109.34	109.36	109.31
LKTB	124.34	0.01	124.55	124.57	124.31

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	8.25	-0.50	8.08	6.78	4.01	8.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	0.80	0.00	1.24	0.72	-1.73	2.40	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.15	-0.45	-3.65	-4.05	-5.76	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-6.70	-0.85	-5.61	-4.97	-6.00	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.70	-0.50	-12.17	-11.96	-13.54	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-16.95	-0.10	-16.80	-15.05	-16.60	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-28.50	-0.60	-27.99	-26.96	-29.85	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-32.45	-0.50	-32.06	-30.63	-32.89	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-36.00	-1.00	-35.12	-32.38	-37.94	-13.95	-48.50	3.00	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1125.50 (-3.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-60.25	-1.00	1Y	0.8850	-1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	11.00	0.50	
-62.00	-0.50	1.5Y	0.9300	-0.50	1.2850	0.8100	2*3Y	9.50	0.00	
-60.25	-0.25	2Y	0.9950	-0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	24.50	-1.50	
-58.50	-0.25	3Y	1.0900	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	-0.50	
-55.00	-0.50	4Y	1.1800	-1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	15.00	-1.50	
-53.75	-1.50	5Y	1.2400	-2.00	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	-1.00	
-55.00	-1.50	7Y	1.2900	-2.00	1.4500	0.6550	5*7Y	5.00	0.00	
-52.25	-1.50	10Y	1.4050	-2.00	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	1.3549	1.59	1.3390	1.3550	1.3471	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2658	4.17	2.2241	2.2686	2.2553	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	-0.2841	1.39	-0.2980	-0.2820	-0.2879	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0138	-4.17	0.0279	-0.0216	0.0047	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	33.00	33.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	71.00	0.00	71.00	70.20	73.40	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	91.09	2.58	88.51	91.36	90.82	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS	Lv.			ODD Tenor					
06M	40.75								
09M									
01Y	48.25								
1.5Y									
02Y	59.25	SPRD			15*20 @ 1.75				
03Y	66.5 66.75								
04Y									
05Y	77.25								
07Y	83								
10Y	92.75								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	45 건		-21	66	67	78	20	69	62
금 액	11,125 억원		-6,730	17,855	15,006	25,958	4,860	14,665	15,553

장중동향

IRS는 전반적으로 한산한 모습을 보이다가 2년이후 소폭 하락 마감. 3년을 제외한 전 테너에서 오퍼가 귀한 모습을 보임. BOE에 비둘기파적인 기조를 보임에 따라 전일 미국 금리가 올랐지만, 국채선물은 보험 정도에 그침. 오늘 미국의 비농업부문 고용지표 발표를 앞두고 경계심이 작용한 것 같음.

CRS도 특별한 거래는 없었음. 전체적으로 한산한 장을 보이다가 소폭 하락 마감.