

IPS Daily Morning Brief

2017-08-08

종가 기준일 2017-08-07

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4200	1.00	1.4115	1.4099	1.4061	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4625	1.25	1.4520	1.4548	1.4421	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5025	1.50	1.4905	1.4964	1.4781	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5700	2.00	1.5535	1.5565	1.5310	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6225	2.50	1.6040	1.6073	1.5717	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7075	3.25	1.6830	1.6858	1.6423	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7650	3.50	1.7400	1.7388	1.6941	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8100	3.25	1.7860	1.7865	1.7394	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8800	4.00	1.8500	1.8490	1.8022	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9700	4.25	1.9385	1.9388	1.8934	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0025	4.25	1.9710	1.9688	1.9258	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0100	4.25	1.9770	1.9736	1.9308	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0275	4.25	1.9920	1.9858	1.9380	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.25	0.25	4.05	4.49	3.60	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.00	0.25	3.85	4.16	3.60	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	12.00	1.00	11.35	11.09	9.36	12.00	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.50	0.75	7.90	7.85	7.05	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.25	1.00	13.60	13.15	12.24	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.75	0.75	18.20	17.93	16.77	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	0.25	5.70	5.30	5.19	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.00	10.30	10.08	9.72	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	-0.25	4.60	4.78	4.53	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.00	0.75	6.40	6.25	6.28	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	16.00	1.00	15.25	15.23	15.40	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.00	0.25	8.85	8.98	9.12	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.00	3.24	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	3.85	3.49	3.75	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.75	0.00	5.35	4.70	4.46	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.415	1.00	1.407	1.427	1.437	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.565	2.30	1.544	1.549	1.548	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.665	2.60	1.643	1.648	1.629	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.775	3.30	1.743	1.737	1.702	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.890	3.30	1.862	1.859	1.829	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.980	3.30	1.955	1.939	1.905	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.161	3.60	2.131	2.119	2.100	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.292	4.00	2.261	2.247	2.222	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.375	3.00	2.345	2.311	2.316	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.39	0.00
CALL	1.20	-0.02

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.21	-0.10	109.27	109.27	109.20
LKTB	123.91	-0.43	124.11	124.12	123.91

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	8.75	0.50	8.37	6.91	4.11	8.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	0.50	-0.30	0.95	0.75	-1.70	2.40	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.25	-0.10	-3.86	-4.07	-5.75	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-6.75	-0.05	-5.96	-5.08	-6.01	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.50	0.20	-12.22	-12.00	-13.51	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-17.00	-0.05	-16.90	-15.21	-16.59	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-28.10	0.40	-28.08	-27.02	-29.78	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-32.20	0.25	-32.21	-30.80	-32.87	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-34.75	1.25	-35.32	-32.54	-37.82	-13.95	-48.50	3.00	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1127.20 (+1.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-60.25	0.00	1Y	0.9000	1.50	1.4000	0.7650	1*2Y	10.50	-0.50	
-62.50	-0.50	1.5Y	0.9450	1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	9.50	0.00	
-61.75	-1.50	2Y	1.0050	1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	24.50	0.00	
-60.75	-2.25	3Y	1.1000	1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	0.00	
-57.50	-2.50	4Y	1.1900	1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	15.00	0.00	
-56.00	-2.25	5Y	1.2500	1.00	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	0.00	
-58.00	-3.00	7Y	1.3000	1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	5.00	0.00	
-55.50	-3.25	10Y	1.4150	1.00	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	0.4	1.3509	1.3390	1.3550	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2551	-1.07	2.2658	2.2241	2.2686	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	-0.3101	-2.2	-0.2881	-0.2980	-0.2820	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	0.0369	5.07	-0.0138	0.0279	-0.0216	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	34.75	1.75	33.00	33.25	33.00	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	72.70	1.70	71.00	71.00	70.20	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	90.02	-1.47	91.49	88.51	91.36	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS	Lv.			ODD Tenor					
06M	41.5								
09M									
01Y	50								
1.5Y	56.5								
02Y				SPRD	2*3y	8.25			
03Y					2*5y	19			
04Y									
05Y	80.25 / 80.75 / 81								
07Y									
10Y	96								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	44 건		-1	45	66	67	78	20	69
금 액	10,480 억원		-645	11,125	17,855	15,006	25,958	4,860	14,665

장중동향
채권은 유엔안보리의 대북제재안이 채택되면서 하락 출발했고, 장 막판 북한의 대북제재 전면배격 뉴스에 급락 마감.

IRS는 오전내 ccp거래가 10건이 채 되지않고 조용한 분위기를 이어갔으나 오후들어 북한의 발표에 큰폭으로 약세를 보이며 비드가 물리며 레벨상승. 커브는 스틱 마감. CRS는 전체적으로 소폭 상승 마감.

국고5년 0.9조 - 낙찰금리 1.980% (선매출)

국고5년 0.75조 - 낙찰금리 1.970%

통안91일물 1.04조 - 낙찰금리 1.26%