

IPS Daily Morning Brief

2017-08-09

종가 기준일 2017-08-08

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4400	2.00	1.4175	1.4111	1.4066	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4825	2.00	1.4585	1.4555	1.4428	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5250	2.25	1.4975	1.4970	1.4791	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5925	2.25	1.5620	1.5573	1.5323	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6450	2.25	1.6125	1.6081	1.5731	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7350	2.75	1.6940	1.6871	1.6438	1.7350	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7925	2.75	1.7510	1.7401	1.6955	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8375	2.75	1.7970	1.7874	1.7406	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.9050	2.50	1.8620	1.8496	1.8033	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9925	2.25	1.9500	1.9389	1.8940	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0250	2.25	1.9825	1.9691	1.9264	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0325	2.25	1.9890	1.9744	1.9315	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0500	2.25	2.0050	1.9869	1.9390	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.25	0.00	4.10	4.44	3.63	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.25	0.25	3.90	4.15	3.63	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	12.00	0.00	11.50	11.11	9.40	12.00	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	9.00	0.50	8.15	7.90	7.06	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.75	0.50	13.85	13.20	12.24	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	19.25	0.50	18.45	17.93	16.75	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	0.00	5.70	5.30	5.18	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.00	10.30	10.03	9.69	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.60	4.73	4.51	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.75	-0.25	6.50	6.23	6.26	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.50	-0.50	15.30	15.15	15.34	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.75	-0.25	8.80	8.93	9.08	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.03	3.23	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	3.90	3.55	3.75	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.75	0.00	5.50	4.80	4.50	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.435	2.00	1.412	1.427	1.437	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.585	2.00	1.556	1.549	1.549	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.687	2.20	1.653	1.649	1.630	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.802	2.70	1.757	1.739	1.704	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.915	2.50	1.874	1.860	1.830	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	2.002	2.20	1.965	1.941	1.906	2.002	1.217	3.430	1.217
7Y	2.178	1.70	2.141	2.120	2.100	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.307	1.50	2.270	2.248	2.222	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.380	0.50	2.354	2.313	2.315	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.39	0.00
CALL	1.21	0.01

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.13	-0.08	109.23	109.25	109.08
LKTb	123.74	-0.17	124.01	124.08	123.59

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	9.00	0.25	8.57	7.05	4.22	9.00	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	0.75	0.25	0.62	0.80	-1.66	2.40	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.20	0.05	-4.05	-4.05	-5.73	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-6.70	0.05	-6.30	-5.14	-6.01	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.25	0.25	-12.32	-12.00	-13.48	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-16.45	0.55	-16.84	-15.32	-16.56	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-27.30	0.80	-27.92	-27.06	-29.70	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-31.45	0.75	-32.00	-30.94	-32.81	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-33.00	1.75	-34.90	-32.65	-37.64	-13.95	-48.50	3.00	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1125.10 (-2.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-61.50	-1.25	1Y	0.9100	1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	11.50	1.00		
-63.25	-0.75	1.5Y	0.9600	1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	10.00	0.50		
-62.00	-0.25	2Y	1.0250	2.00	1.2250	0.7950	2*5Y	25.00	0.50		
-61.00	-0.25	3Y	1.1250	2.50	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	0.00		
-57.75	-0.25	4Y	1.2150	2.50	1.3750	0.6900	3*5Y	15.00	0.00		
-56.25	-0.25	5Y	1.2750	2.50	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	0.00		
-58.00	0.00	7Y	1.3250	2.50	1.4500	0.6550	5*7Y	5.00	0.00		
-55.25	0.25	10Y	1.4400	2.50	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	1.3548	-0.01	1.3549	1.3509	1.3390	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2640	0.89	2.2551	2.2658	2.2241	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	-0.3322	-2.21	-0.3101	-0.2881	-0.2980	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	0.0430	0.61	0.0369	-0.0138	0.0279	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	0.00	34.75	33.00	33.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	72.20	-0.50	72.70	71.00	71.00	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	90.92	0.90	90.02	91.49	88.51	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS	Lv.				ODD Tenor				
06M	43.25								
09M	46.25 / 46.5								
01Y	50.25 / 50.5								
1.5Y	57.25								
02Y					SPRD	9*12M 04			
03Y	70.75 / 73.5					1*2Y 11.75 / 12			
04Y						3*5Y 9.75			
05Y						5*6Y 3.5			
07Y						5*10Y 15.5			
10Y	97 / 00								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	4Y 19								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	127 건	83	44	45	66	67	78	20	
금 액	47,310 억원	36,830	10,480	11,125	17,855	15,006	25,958	4,860	

장중동향
 채권시장은 미국금리를 반영해 소폭 강세로 시작했으나, 기준금리 인상과 관련한 일부 기사와 외인의 선물 매도 영향으로 약세 전환 마감.
 (집값 잡기 위한 기준금리 조정 바람직하지 않아 - 정부 고위 관계자 - Reuters News)

IRS, 전 구간에서 상승 마감. 특히 3~4년 구간은 연고점까지 오르는 등 대폭 상승.

CRS 금리도 전체적으로 오름세. 의미 있는 거래는 많지 않은 가운데 IRS 연동.