

IPS Daily Morning Brief

2017-08-11

종가 기준일 2017-08-10

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4300	-1.50	1.4290	1.4135	1.4075	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4750	-2.25	1.4735	1.4578	1.4446	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5225	-2.25	1.5165	1.4996	1.4816	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5975	-1.75	1.5850	1.5610	1.5357	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6500	-2.00	1.6370	1.6123	1.5771	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7375	-2.25	1.7230	1.6919	1.6480	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7900	-2.25	1.7780	1.7448	1.6995	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8325	-2.75	1.8235	1.7915	1.7443	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8950	-2.75	1.8885	1.8531	1.8065	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9850	-2.50	1.9770	1.9421	1.8966	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0150	-2.75	2.0090	1.9726	1.9288	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0250	-2.50	2.0170	1.9784	1.9341	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0450	-2.50	2.0355	1.9919	1.9422	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.50	-0.75	4.45	4.43	3.70	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.75	0.00	4.30	4.19	3.70	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	12.75	0.25	12.05	11.26	9.55	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.75	-0.25	8.60	7.96	7.09	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.00	-0.25	14.10	13.25	12.24	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.25	-0.75	18.65	17.93	16.72	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	0.00	5.50	5.29	5.15	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.50	-0.50	10.05	9.96	9.63	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	-0.50	4.55	4.68	4.48	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.25	0.00	6.50	6.16	6.22	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.25	0.25	15.35	15.06	15.23	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.00	0.25	8.85	8.90	9.02	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	-0.25	3.20	3.05	3.22	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.00	3.62	3.75	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	6.00	0.00	5.85	4.98	4.56	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.481	0.90	1.442	1.430	1.438	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.632	0.80	1.590	1.555	1.552	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.697	-1.30	1.680	1.653	1.633	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.811	-2.00	1.792	1.745	1.708	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.925	-1.70	1.906	1.866	1.834	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	2.015	-1.70	1.995	1.948	1.910	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.189	-1.70	2.172	2.126	2.102	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.315	-1.70	2.300	2.255	2.224	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.387	-1.80	2.378	2.322	2.315	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	109.08	0.06	109.04	109.08	108.94
LKTb	123.69	0.17	123.54	123.69	123.22

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	4.15	-3.15	7.49	7.01	4.35	9.00	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-3.45	-2.55	-0.46	0.62	-1.66	2.40	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.70	-0.70	-4.26	-4.03	-5.63	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-7.35	-0.25	-6.92	-5.33	-5.99	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-13.50	-0.55	-12.78	-12.10	-13.40	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-18.25	-1.05	-17.17	-15.66	-16.54	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-29.40	-1.05	-28.33	-27.33	-29.55	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-33.00	-0.80	-32.26	-31.26	-32.71	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-34.20	-0.70	-34.29	-33.01	-37.29	-13.95	-48.50	2.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1141.95 (+3.95)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-63.25	2.75	1Y	0.8900	0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	10.50	-1.00		
-66.25	1.75	1.5Y	0.9350	0.00	1.2850	0.8100	2*3Y	10.00	0.00		
-65.50	1.50	2Y	0.9950	-0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	25.00	0.00		
-64.25	1.75	3Y	1.0950	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	0.00		
-60.50	1.75	4Y	1.1850	-0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	15.00	0.00		
-58.75	2.25	5Y	1.2450	-0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	0.00		
-60.00	2.25	7Y	1.2950	-0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	5.00	0.00		
-57.50	2.00	10Y	1.4100	-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	1.3266	-2.02	1.3468	1.3548	1.3549	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1959	-5.56	2.2515	2.2640	2.2551	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	-0.3704	-0.72	-0.3632	-0.3322	-0.3101	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	0.1191	3.86	0.0805	0.0430	0.0369	0.1191	-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	33.50	-0.50	34.00	34.75	34.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	68.30	-2.50	70.80	72.20	72.70	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	86.93	-3.54	90.47	90.92	90.02	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS	Lv.			ODD Tenor	9y 96				
06M									
09M									
01Y	53.5 / 54								
1.5Y									
02Y	64.75 / 66.5			SPRD	5*10y 15				
03Y									
04Y									
05Y	83.5 / 84.25 / 84.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1*1.5y 05								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	136 건	-2	138	127	44	45	66	67	
금 액	25,814 억원	-28,681	54,495	47,310	10,480	11,125	17,855	15,006	

장종동향

채권은 북한의 지정학적 리스크에 따른 불안한 모습을 보이며 등락을 거듭, 소폭 강세로 마감.

IRS는 장 시작부터 오퍼가 많았고, 본드스왑 연와인딩 물량으로 전구간에 걸쳐 오퍼리시한 분위기 속에 거래가 활발. 전테너 레벨 하락하며 커브 플랫 마감.

CRS는 1년, 1.5년을 제외하고 전구간 0.5bp 하락 마감.