IPS Daily Morning Brief

2017-08-16

종가 기준일 2017-08-15

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4325	0.50	1.4325	1.4156	1.4089	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4750	0.50	1.4775	1.4588	1.4469	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5200	0.50	1.5235	1.5008	1.4849	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5875	0.50	1.5930	1.5634	1.5404	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6350	0.25	1.6440	1.6143	1.5825	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7225	0.25	1.7320	1.6948	1.6542	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7775	0.50	1.7850	1.7475	1.7057	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8150	0.25	1.8265	1.7923	1.7498	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8725	0.25	1.8860	1.8528	1.8112	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9625	0.25	1.9755	1.9418	1.9007	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9925	0.25	2.0060	1.9728	1.9326	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0050	0.25	2.0170	1.9796	1.9381	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0275	0.25	2.0385	1.9950	1.9471	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.25	0.00	4.50	4.31	3.80	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.50	0.00	4.60	4.20	3.80	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.50	-0.25	12.05	11.35	9.76	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.75	0.00	8.80	8.05	7.17	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.25	0.25	14.10	13.33	12.32	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.00	0.00	18.25	17.80	16.73	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.25	5.30	5.28	5.15	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.25	0.00	9.45	9.75	9.56	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.75	-0.25	4.15	4.48	4.41	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.75	0.00	5.95	6.05	6.14	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	14.75	0.00	14.90	14.95	15.09	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.00	0.00	8.95	8.90	8.95	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.05	3.10	3.19	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.15	3.79	3.75	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	6.50	0.00	6.30	5.33	4.64	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.503	1.10	1.488	1.437	1.441	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.657	1.20	1.641	1.568	1.559	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.720	2.30	1.704	1.659	1.638	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.807	0.50	1.811	1.754	1.714	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.915	0.30	1.921	1.872	1.839	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	2.002	0.20	2.010	1.956	1.915	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.178	0.70	2.183	2.132	2.105	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.302	0.70	2.308	2.260	2.226	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.355	-0.70	2.374	2.330	2.314	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	109.09	-0.01	109.14	109.16	109.09
LKTB	123.86	-0.04	124.07	124.11	123.86

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.70	-0.60	3.55	6.34	4.39	9.00	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-6.95	-0.70	-4.76	-0.44	-1.82	2.40	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-8.50	-2.05	-6.02	-4.51	-5.60	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-8.45	-0.25	-7.86	-5.88	-6.01	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-13.75	0.20	-13.62	-12.41	-13.31	-3.20	-30.35	5.00	-30.35
5Y	-18.70	0.05	-18.33	-16.36	-16.55	-2.25	-27.25	7.00	-27.25
7Y	-30.55	-0.45	-29.70	-27.96	-29.38	-7.50	-37.65	1.75	-37.65
10Y	-33.95	-0.45	-33.23	-31.83	-32.55	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-32.75	0.95	-33.57	-33.48	-36.67	-13.95	-48.50	0.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-64.00	-1.00
-66.75	-1.00
-66.50	-1.25
-65.75	-1.25
-62.25	-1.50
-60.00	-1.25
-60.25	-1.25
-57.75	-1.25

CRS

USD/KRW 1140.50 (-3.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8800	-0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	9.00	-0.50
1.5Y	0.9200	-0.50	1.2850	0.8100	2*3Y	9.50	0.00
2Y	0.9700	-1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	24.50	0.00
3Y	1.0650	-1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	0.00
4Y	1.1550	-1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	15.00	0.00
5Y	1.2150	-1.00	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.2700	-1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	5.50	0.00
10Y	1.3850	-1.00	1.9050	0.6300	5*10Y	17.00	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	1.3505	2.42	1.3263	1.2980	1.3266	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2746	5.26	2.2220	2.1941	2.1959	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	-0.3695	0.12	-0.3707	-0.3990	-0.3704	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	0.0274	-4.56	0.0730	0.1009	0.1191	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	32.75	0.00	32.75	32.75	33.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	58.20	-1.60	59.80	59.80	61.80	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	92.41	2.84	89.57	89.61	86.93	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M	42.25 42.75	ODD Tenor	
09M			
01Y	52.25		
1.5Y			
02Y		SPRD	1*2/11.5
03Y			3*5/5.25
04Y			
05Y	80.25 80.5		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	46 건	-32	78	78	136	138	127	44
금 액	18,930 억원	-261	19,191	19,191	25,814	54,495	47,310	10,480

장중동향

14일 IRS는 징검다리 휴일로 인해 한산한 장을 보이다가 국채선물 약세 흐름을 반영해 소폭 상승마감. 북한 관련 지정학적 위험이 지속되는 분위기로 인해 증시 또한 양봉이 나오지 않고 있음.

전 테너 오퍼를 찾는 분위기였으며 오퍼가 나오면 테이큰이 되는 모습을 보임. 1년이하 짧은쪽이 거래가 활발했으며 4년과 5년 거래소식이 몇번 있었음.

14일 CRS 금리는 전체적으로 하락 마감. 북한 관련 경계심으로 인해 오퍼 쪽으로 나오고 약간 빠진 상태로 끝났음.