IPS Daily Morning Brief

2017-08-17

종가 기준일 2017-08-16

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4400	0.75	1.4325	1.4174	1.4097	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4875	1.25	1.4765	1.4604	1.4481	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5350	1.50	1.5225	1.5026	1.4865	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.6050	1.75	1.5920	1.5656	1.5425	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6550	2.00	1.6415	1.6161	1.5848	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7425	2.00	1.7290	1.6970	1.6568	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7975	2.00	1.7830	1.7501	1.7084	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8400	2.50	1.8230	1.7944	1.7524	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.9000	2.75	1.8820	1.8549	1.8136	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9900	2.75	1.9720	1.9439	1.9028	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0200	2.75	2.0020	1.9751	1.9347	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0325	2.75	2.0140	1.9824	1.9403	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0550	2.75	2.0360	1.9984	1.9495	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.75	0.50	4.40	4.30	3.85	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.75	0.25	4.60	4.23	3.84	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	12.00	0.50	11.90	11.35	9.83	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.75	0.00	8.75	8.09	7.20	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.25	0.00	14.15	13.40	12.36	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.50	0.50	18.15	17.83	16.76	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.00	5.40	5.31	5.16	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	0.50	9.40	9.74	9.56	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.50	4.00	4.43	4.40	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.00	0.25	5.90	6.05	6.12	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.00	0.25	14.90	14.95	15.05	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.00	0.00	9.00	8.90	8.93	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	3.13	3.18	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.20	3.85	3.75	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	6.50	0.00	6.40	5.45	4.67	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.516	1.30	1.499	1.442	1.442	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.670	1.30	1.652	1.574	1.561	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.732	1.20	1.713	1.664	1.641	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.820	1.30	1.809	1.757	1.717	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.932	1.70	1.920	1.875	1.841	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	2.025	2.30	2.009	1.960	1.918	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.203	2.50	2.184	2.136	2.107	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.332	3.00	2.309	2.264	2.228	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.387	3.20	2.369	2.334	2.314	2.430	1.430	3.943	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.04	-0.05	109.05	109.06	109.02
LKTB	123.59	-0.27	123.61	123.68	123.51

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	1.90	0.20	2.35	6.09	4.41	9.00	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-6.50	0.45	-6.02	-0.85	-1.85	2.40	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-7.70	0.80	-7.17	-4.79	-5.61	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-7.75	0.70	-8.04	-6.04	-5.99	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-13.45	0.30	-13.68	-12.46	-13.26	-3.20	-30.35	5.00	-30.35
5Y	-18.50	0.20	-18.58	-16.55	-16.52	-2.25	-27.25	7.00	-27.25
7Y	-30.30	0.25	-30.18	-28.15	-29.31	-7.50	-37.65	1.75	-37.65
10Y	-34.20	-0.25	-33.72	-32.02	-32.48	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-33.20	-0.45	-33.32	-33.54	-36.40	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-63.50	0.50
-66.50	0.25
-67.50	-1.00
-67.25	-1.50
-63.75	-1.50
-62.00	-2.00
-62.50	-2.25
-60.00	-2.25

CRS

USD/KRW 1141.60 (+1.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9000	2.00	1.4000	0.7650	1*2Y	8.00	-1.00
1.5Y	0.9400	2.00	1.2850	0.8100	2*3Y	9.00	-0.50
2Y	0.9800	1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	24.00	-0.50
3Y	1.0700	0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	0.00
4Y	1.1600	0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	15.00	0.00
5Y	1.2200	0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	6.00	0.00
7Y	1.2750	0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	5.50	0.00
10Y	1.3900	0.50	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	1.3343	-1.62	1.3505	1.3263	1.2980	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2272	-4.74	2.2746	2.2220	2.1941	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	-0.3977	-2.82	-0.3695	-0.3937	-0.3990	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	0.1048	7.74	0.0274	0.0800	0.1009	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	0.75	32.75	32.75	32.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	60.00	1.80	58.20	58.20	59.80	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	89.29	-3.12	92.41	89.57	89.61	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M	44.25	ODD Tenor	
09M	49		
01Y			
1.5Y	60		
02Y	64.5 / 65	SPRD	9*24m 16.25
03Y	73.25 / 73.75 / 74 / 74.25		3*5y 9.75
04Y	80		5*10y 14.5 / 15
05Y	83 / 83.75 / 84		
07Y			
10Y	98.5 / 98.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	94 건	48	46	46	78	136	138	127
금 액	28,605 억원	9,675	18,930	18,930	19,191	25,814	54,495	47,310

장중동향

채권은 북한리스크가 완화와 10년국채 입찰 부진으로 약세를 보이며 금리 상승 마감.

IRS는 국채선물 약세와 연동해 레벨이 상승했고, 2년부터 5년구간으로 비디쉬. 특히 장 후반 5년쪽으로 페이가 강하게 올라오며 커브 스팁 마감.

CRS도 전체적으로 상승 마감.