IPS Daily Morning Brief

2017-08-21

종가 기준일 2017-08-18

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4325	0.00	1.4340	1.4199	1.4107	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4825	0.00	1.4805	1.4631	1.4501	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5250	-0.50	1.5260	1.5056	1.4890	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5925	-0.25	1.5935	1.5694	1.5458	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6425	-0.25	1.6425	1.6199	1.5886	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7275	-0.25	1.7290	1.7014	1.6612	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7875	-0.25	1.7860	1.7555	1.7130	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8300	0.00	1.8260	1.7993	1.7568	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8925	0.25	1.8855	1.8604	1.8177	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9800	0.00	1.9750	1.9494	1.9064	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0125	0.25	2.0055	1.9811	1.9381	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0275	0.25	2.0190	1.9894	1.9439	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0500	0.25	2.0415	2.0065	1.9537	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	5.00	0.00	4.65	4.33	3.94	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.25	-0.50	4.55	4.25	3.90	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.75	0.25	11.65	11.43	9.95	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.50	0.00	8.65	8.15	7.26	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.50	0.00	14.35	13.56	12.45	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.75	0.25	18.35	17.94	16.82	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	6.00	0.00	5.70	5.41	5.19	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.25	9.70	9.79	9.56	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.25	4.00	4.38	4.37	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.25	0.25	5.95	6.11	6.10	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.00	0.00	14.90	15.01	14.97	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.75	-0.25	8.95	8.90	8.87	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.25	3.05	3.18	3.17	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.25	4.40	4.00	3.75	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.00	0.25	6.65	5.71	4.73	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.505	-1.10	1.509	1.449	1.444	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.642	-1.30	1.656	1.584	1.565	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.705	-0.70	1.718	1.670	1.644	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.782	-0.90	1.801	1.763	1.720	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.902	-0.90	1.915	1.880	1.844	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	2.000	-0.50	2.007	1.968	1.921	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.186	-0.10	2.186	2.145	2.109	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.317	0.00	2.314	2.273	2.230	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.390	0.30	2.375	2.343	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	109.13	0.02	109.16	109.17	109.13
LKTB	123.70	-0.01	123.93	123.95	123.70

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	2.00	0.60	1.74	5.64	4.47	9.00	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-4.95	1.05	-6.27	-1.46	-1.89	2.40	-19.10	9.00	-19.10
2Y	-6.25	0.45	-7.53	-5.01	-5.55	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.45	0.65	-7.24	-6.17	-5.90	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.45	0.65	-12.90	-12.46	-13.08	-3.20	-30.35	4.25	-30.35
5Y	-17.00	0.50	-18.08	-16.85	-16.41	-2.25	-27.25	6.25	-27.25
7Y	-29.35	0.35	-30.09	-28.43	-29.12	-7.50	-37.65	1.75	-37.65
10Y	-33.70	0.00	-33.90	-32.37	-32.33	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-34.00	-0.05	-33.33	-33.66	-35.99	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-63.00	-0.50
-66.75	-1.25
-68.75	-1.75
-68.75	-1.75
-64.75	-0.75
-62.00	-0.50
-62.75	-0.75
-60.00	-0.50

CRS

USD/KRW 1141.50 (+4.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8950	-1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	6.00	-1.00
1.5Y	0.9250	-1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	8.50	0.00
2Y	0.9550	-2.00	1.2250	0.7950	2*5Y	25.50	1.50
3Y	1.0400	-2.00	1.3150	0.7350	3*4Y	10.00	1.00
4Y	1.1400	-1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	17.00	1.50
5Y	1.2100	-0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	7.00	0.50
7Y	1.2650	-0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	5.50	0.00
10Y	1.3800	-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	1.3136	1.19	1.3017	1.3343	1.3505	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1957	0.69	2.1888	2.2272	2.2746	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	-0.3914	1.89	-0.4103	-0.3977	-0.3695	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	0.1213	-0.69	0.1282	0.1048	0.0274	0.1282	-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	33.75	0.25	33.50	33.50	32.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	61.20	0.70	60.50	60.00	58.20	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	88.21	-0.50	88.71	89.29	92.41	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	
09M	48 48.25		
01Y	52.5 52.75		
1.5Y			
02Y		SPRD	9*12/4.5
03Y	72.5		4*5/04
04Y	78.5 78.75		4*5/4.25
05Y	83		
07Y			
10Y			
12Y	0.5		
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	56 건	-13	69	94	46	46	78	136
금 액	12,085 억원	-5,908	17,993	28,605	18,930	18,930	19,191	25,814

장중동향

IRS는 단기물을 중심으로 국채선물 흐름을 반영해 강보합세를 보임. 국채선물이 아침에 강세를 보이다가 마지막에 빠지면서 결국 보합권을 유지함. IRS 금리도 장중 빠져있다가 선물에 맞춰서 움직임을 보임.
아침에 3년 위주로 거래가 이뤄지다가 오후에는 거래가 거의 없다가 종가가 나온후 4*5년 거래가 몇번 있었음.

CRS는 특별한 거래가 없는 가운데 전체적으로 하락 마감. 다음 주 을지훈련 등을 앞두고 관망 분위기가 형성된듯함.