

IPS Daily Morning Brief

2017-08-22

종가 기준일 2017-08-21

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4350	0.25	1.4345	1.4213	1.4113	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4875	0.50	1.4830	1.4649	1.4512	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5300	0.50	1.5280	1.5074	1.4904	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5975	0.50	1.5955	1.5718	1.5476	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6475	0.50	1.6450	1.6223	1.5906	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7300	0.25	1.7305	1.7041	1.6634	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7875	0.00	1.7880	1.7586	1.7154	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8325	0.25	1.8295	1.8024	1.7590	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8950	0.25	1.8900	1.8639	1.8198	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9800	0.00	1.9785	1.9528	1.9083	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0125	0.00	2.0095	1.9848	1.9399	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0275	0.00	2.0235	1.9935	1.9458	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0500	0.00	2.0460	2.0111	1.9558	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.25	0.25	4.85	4.36	3.99	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.25	0.00	4.50	4.25	3.92	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.75	0.00	11.70	11.49	10.02	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.25	-0.25	8.55	8.19	7.28	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	14.00	-0.50	14.30	13.64	12.48	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.50	-0.25	18.45	18.01	16.84	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	-0.25	5.75	5.45	5.20	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.00	9.90	9.83	9.56	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.25	4.15	4.38	4.36	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.25	0.00	6.05	6.15	6.08	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	14.75	-0.25	14.90	15.04	14.93	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.50	-0.25	8.85	8.89	8.85	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.10	3.20	3.16	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.50	4.08	3.75	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.00	0.00	6.75	5.84	4.75	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.502	-0.30	1.508	1.453	1.445	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.642	0.00	1.653	1.589	1.566	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.716	1.10	1.717	1.674	1.646	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.787	0.50	1.797	1.767	1.722	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.902	0.00	1.912	1.883	1.845	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.997	-0.30	2.006	1.972	1.923	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.181	-0.50	2.187	2.149	2.110	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.307	-1.00	2.315	2.277	2.231	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.375	-1.50	2.379	2.348	2.314	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	109.12	-0.01	109.11	109.16	109.11
LKTb	123.84	0.14	123.63	123.92	123.62

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	2.80	0.80	1.96	5.47	4.52	9.00	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-4.45	0.50	-5.77	-1.71	-1.88	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-6.85	-0.60	-7.20	-5.13	-5.33	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.70	-0.25	-6.69	-6.25	-5.86	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.45	0.00	-12.44	-12.46	-13.00	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-16.45	0.55	-17.63	-16.96	-16.37	-2.25	-27.25	5.00	-27.25
7Y	-28.60	0.75	-29.70	-28.52	-29.04	-7.50	-37.65	0.75	-37.65
10Y	-32.70	1.00	-33.65	-32.47	-32.26	-12.95	-38.70	5.00	-38.70
20Y	-32.50	1.50	-33.28	-33.64	-35.79	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1138.85 (-2.65)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-62.50	0.50	1Y	0.9050	1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	7.00	1.00	
-65.75	1.00	1.5Y	0.9400	1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	10.50	2.00	
-67.25	1.50	2Y	0.9750	2.00	1.2250	0.7950	2*5Y	30.00	4.50	
-65.00	3.75	3Y	1.0800	4.00	1.3150	0.7350	3*4Y	10.50	0.50	
-60.25	4.50	4Y	1.1850	4.50	1.3750	0.6900	3*5Y	19.50	2.50	
-55.75	6.25	5Y	1.2750	6.50	1.4350	0.6600	4*5Y	9.00	2.00	
-56.50	6.25	7Y	1.3300	6.50	1.4500	0.6550	5*7Y	5.50	0.00	
-53.50	6.50	10Y	1.4450	6.50	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	1.3094	-0.42	1.3136	1.3017	1.3343	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1843	-1.14	2.1957	2.1888	2.2272	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	-0.4066	-1.52	-0.3914	-0.4103	-0.3977	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	0.1227	0.14	0.1213	0.1282	0.1048	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	33.25	-0.50	33.75	33.50	33.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	59.10	-2.10	61.20	60.50	60.00	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	87.49	-0.72	88.21	88.71	89.29	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS	Lv.		ODD Tenor		SPRD				
06M	43.5								
09M	48.75								
01Y									
1.5Y	59.75								
02Y		1*3y 20.25							
03Y	72.75								
04Y	78.75								
05Y	83								
07Y									
10Y	97.5 / 97.75								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	52 건	-4	56	69	94	46	46	78	
금 액	11,940 억원	-145	12,085	17,993	28,605	18,930	18,930	19,191	

장중동향

금일 채권은 국고채 20년물 입찰이 호조를 보이면서 장기물이 강세를 보이며 커브 플레이트닝 마감.

IRS는 오전내내 조용한 분위기. 오퍼가 없어서 9개월부터 4년구간으로 비드만 대기하다가 전일비 수준에서 3년이 한두차례 거래. 오후들어 단기를 중심으로 비드가 강하게 버티면서 커브가 누운채 마감.

CRS는 장기쪽으로 갈수록 큰폭으로 상승. 5년,10년쪽으로 부채물량이 있었던것으로 보임.