

IPS Daily Morning Brief

2017-08-24

종가 기준일 2017-08-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4400	-0.50	1.4370	1.4253	1.4129	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4950	-0.25	1.4890	1.4700	1.4538	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5400	-0.25	1.5335	1.5128	1.4935	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.6075	-0.25	1.6005	1.5781	1.5515	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6575	-0.50	1.6510	1.6288	1.5948	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7375	-1.00	1.7345	1.7114	1.6680	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7875	-1.00	1.7900	1.7658	1.7198	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8325	-1.00	1.8335	1.8094	1.7632	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8900	-1.00	1.8935	1.8708	1.8235	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9750	-1.00	1.9800	1.9593	1.9114	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0075	-1.00	2.0120	1.9910	1.9428	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0225	-1.00	2.0270	2.0008	1.9489	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0450	-1.00	2.0495	2.0194	1.9595	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.50	0.25	5.20	4.48	4.08	5.50	-6.00	5.50	-6.50
9*12M	4.50	0.00	4.45	4.28	3.98	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.75	-0.25	11.75	11.60	10.13	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	-0.50	8.35	8.26	7.32	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.00	-0.50	13.90	13.70	12.50	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.50	-0.50	18.25	18.06	16.84	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	5.55	5.44	5.18	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.50	0.00	9.90	9.80	9.53	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.35	4.36	4.34	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.75	0.00	6.00	6.14	6.03	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	14.25	0.00	14.65	14.99	14.82	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.50	0.00	8.65	8.85	8.79	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.20	3.18	3.14	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.70	4.15	3.75	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.00	0.00	6.95	6.01	4.81	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.510	0.50	1.508	1.461	1.447	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.653	-0.30	1.650	1.601	1.571	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.725	-1.00	1.719	1.683	1.650	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.795	-0.70	1.791	1.775	1.727	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.904	-1.00	1.907	1.890	1.849	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.997	-1.30	2.002	1.981	1.927	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.174	-1.20	2.183	2.158	2.113	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.292	-1.50	2.308	2.285	2.233	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.375	0.30	2.380	2.357	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	0.05	109.06	109.12	109.05
LKTb	123.98	0.16	123.76	123.98	123.68

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	3.00	-0.75	2.59	5.19	4.64	9.00	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-4.55	0.05	-4.91	-2.26	-1.91	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-6.75	0.50	-6.76	-5.38	-5.54	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.75	-0.30	-5.69	-6.35	-5.86	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.65	0.00	-11.66	-12.46	-12.92	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-16.45	0.30	-16.83	-17.13	-16.36	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-28.40	0.20	-28.93	-28.69	-28.94	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-31.70	0.50	-32.80	-32.56	-32.17	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-33.00	-1.30	-33.03	-33.74	-35.46	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1131.80 (-2.00)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-62.50	-0.25	1Y	0.9150	-0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	9.00	0.50
-65.25	-0.25	1.5Y	0.9550	-0.50	1.2850	0.8100	2*3Y	11.00	0.50
-65.25	0.50	2Y	1.0050	0.00	1.2250	0.7950	2*5Y	33.00	3.00
-62.25	1.50	3Y	1.1150	0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	11.00	0.50
-56.25	2.00	4Y	1.2250	1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	22.00	2.50
-49.75	4.00	5Y	1.3350	3.00	1.4350	0.6600	4*5Y	11.00	2.00
-46.50	6.50	7Y	1.4250	5.50	1.4500	0.6550	5*7Y	9.00	2.50
-43.50	6.50	10Y	1.5400	5.50	1.9050	0.6300	5*10Y	20.50	2.50

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	1.3051	-2.88	1.3339	1.3094	1.3136	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1677	-4.63	2.2140	2.1843	2.1957	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	-0.4199	-1.88	-0.4011	-0.4066	-0.3914	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.1243	-3.13	-0.0930	-0.1227	-0.1213	0.4740	-0.1282	0.4740	-1.2400

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	31.75	-0.50	32.25	33.25	33.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	56.70	-0.50	57.20	59.10	61.20	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	86.26	-1.75	88.01	87.49	88.21	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS	Lv.				ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y	54.75								
1.5Y									
02Y	66.5				SPRD	6*9*12m/01			
03Y	74.75 / 75					2*5y/18			
04Y	80.25					4*5y/4.25			
05Y	84.5					3*7y/15.25			
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	5y / 34.5								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	63 건		3	60	52	56	69	94	46
금 액	15,262 억원		-9,928	25,190	11,940	12,085	17,993	28,605	18,930

장중동향
국고채 금리가 상승과 하락을 오가다 결국 하락세로 마감. 50년물 국고채 발행 이슈가 채권시장의 분위기를 좌우함.

IRS는 국채선물 움직임에 영향을 받아 소폭 하락. 전반적으로 비디쉬한 장세가 이어지다가 장 막판 선물이 강세로 전환되면서 IRS 금리도 떨어짐. 유럽 장이 열린 데 영향을 받은 것 같아 보임.

CRS 금리는 중·장기물을 중심으로 오름·뒤쪽으로 강하게 비드가 나온걸로 보이면서 현대캐피탈 외화채권을 발행한 여진이 지속되는듯함.