

IPS Daily Morning Brief

2017-08-25

종가 기준일 2017-08-24

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4375	-0.25	1.4380	1.4269	1.4136	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4950	0.00	1.4915	1.4726	1.4550	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5400	0.00	1.5355	1.5156	1.4950	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.6125	0.50	1.6040	1.5818	1.5534	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6600	0.25	1.6540	1.6324	1.5969	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7400	0.25	1.7365	1.7154	1.6702	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7925	0.50	1.7905	1.7699	1.7220	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8375	0.50	1.8350	1.8135	1.7653	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8950	0.50	1.8945	1.8748	1.8254	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9775	0.25	1.9795	1.9629	1.9129	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	2.0100	0.25	2.0120	1.9946	1.9443	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	2.0250	0.25	2.0270	2.0049	1.9504	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0525	0.75	2.0505	2.0243	1.9614	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.75	0.25	5.35	4.58	4.14	5.75	-6.00	5.75	-6.50
9*12M	4.50	0.00	4.40	4.30	4.01	4.75	-4.00	4.75	-5.50
1*2Y	12.00	0.25	11.85	11.68	10.18	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	0.00	8.25	8.30	7.33	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.25	0.25	13.65	13.75	12.51	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.75	0.25	18.10	18.11	16.85	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	0.25	5.40	5.45	5.18	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	0.25	9.85	9.81	9.52	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.00	4.45	4.36	4.34	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.75	0.00	5.95	6.13	6.00	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	14.00	-0.25	14.45	14.94	14.76	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.25	-0.25	8.50	8.81	8.75	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.25	0.00	3.25	3.18	3.13	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.75	4.20	3.75	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.50	0.50	7.10	6.14	4.85	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.511	0.10	1.507	1.466	1.448	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.657	0.40	1.650	1.607	1.573	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.727	0.20	1.722	1.688	1.652	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.800	0.50	1.793	1.779	1.729	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.907	0.50	1.906	1.894	1.851	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.997	0.00	2.000	1.985	1.929	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.174	0.00	2.180	2.162	2.114	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.292	0.00	2.303	2.289	2.234	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.387	1.20	2.380	2.362	2.314	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.39	0.00
CALL	1.22	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.11	-0.01	109.16	109.16	109.11
LKTb	124.00	0.02	124.15	124.15	123.99

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	2.90	-0.10	2.89	5.00	4.68	9.00	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-4.45	0.10	-4.60	-2.55	-1.93	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-6.70	0.05	-6.76	-5.53	-5.54	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-6.00	-0.25	-5.67	-6.39	-5.86	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.45	0.20	-11.53	-12.43	-12.87	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-15.95	0.50	-16.52	-17.17	-16.33	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-27.90	0.50	-28.57	-28.73	-28.87	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-31.45	0.25	-32.35	-32.57	-32.11	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-33.45	-0.45	-32.93	-33.77	-35.31	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1128.00 (-3.80)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-62.50	0.00	1Y	0.9150	0.00	1.4000	0.7650	1*2Y	8.50	-0.50	
-65.75	-0.50	1.5Y	0.9550	0.00	1.2850	0.8100	2*3Y	11.00	0.00	
-66.00	-0.75	2Y	1.0000	-0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	33.00	0.00	
-63.00	-0.75	3Y	1.1100	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	11.00	0.00	
-57.25	-1.00	4Y	1.2200	-0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	22.00	0.00	
-50.75	-1.00	5Y	1.3300	-0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	11.00	0.00	
-44.50	2.00	7Y	1.4500	2.50	1.4500	0.6550	5*7Y	12.00	3.00	
-39.75	3.75	10Y	1.5800	4.00	1.9050	0.6300	5*10Y	25.00	4.50	

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	1.3338	2.87	1.3051	1.3339	1.3094	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1991	3.14	2.1677	2.2140	2.1843	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	-0.3932	2.67	-0.4199	-0.4011	-0.4066	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0929	3.14	-0.1243	-0.0930	-0.1227	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	0.00	31.75	32.25	33.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	56.50	-0.20	56.70	57.20	59.10	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	86.53	0.27	86.26	88.01	87.49	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS	Lv.				ODD Tenor					
06M										
09M	49.25									
01Y	53.75									
1.5Y	61.25									
02Y	65.25									
03Y	73.25 / 73.5 / 73.75 / 74				SPRD	9*24m	16.25			
04Y						3*5y	9.5			
05Y	82.75 / 83 / 83.25					3*10y	23.75			
07Y	87.75 / 88.75					5*10y	14			
10Y	97.75					6*7y	2.5			
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	3y 11 / 11.5									
	5y 34.5									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			87 건	24	63	60	52	56	69	94
금 액			24,464 억원	9,202	15,262	25,190	11,940	12,085	17,993	28,605

장중동향

채권은 전일 트럼프의 섣다른 발언으로 강세를 보인 미국채권의 영향으로 강세 출발. 액스홀과 금통위를 앞두고 관망 분위기를 보이며 보합 마감.

IRS는 3년과 5년 전일비 수준에서 활발히 거래되며 시작. 각종 이벤트를 앞두고 제한적인 움직임이었고, 강세를보이던 선물이 보합권으로 돌아오면서 커브 보합 마감.

CRS는 5년까지 오퍼가 많았고, 장기구간이 많이 올라오면서 커브 스텝마감.