

IPS Daily Morning Brief

2017-08-28

종가 기준일 2017-08-25

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4325	-0.50	1.4380	1.4283	1.4143	1.5925	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4850	-1.00	1.4920	1.4746	1.4562	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5300	-1.00	1.5365	1.5179	1.4965	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5975	-1.50	1.6050	1.5845	1.5554	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6375	-2.25	1.6530	1.6345	1.5989	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7125	-2.75	1.7335	1.7175	1.6723	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7675	-2.50	1.7865	1.7724	1.7241	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8100	-2.75	1.8310	1.8159	1.7674	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8675	-2.75	1.8895	1.8770	1.8271	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9475	-3.00	1.9730	1.9646	1.9143	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9775	-3.25	2.0050	1.9963	1.9455	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9950	-3.00	2.0205	2.0071	1.9518	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0200	-3.25	2.0445	2.0271	1.9632	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.25	-0.50	5.40	4.64	4.19	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.50	0.00	4.45	4.33	4.04	4.75	-4.00	4.75	-5.00
1*2Y	10.75	-1.25	11.65	11.66	10.23	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.50	-0.50	8.05	8.30	7.34	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.00	-0.25	13.35	13.79	12.52	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.25	-0.50	17.80	18.14	16.85	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.25	5.30	5.49	5.18	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	0.00	9.75	9.84	9.51	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	-0.25	4.45	4.35	4.33	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.75	0.00	5.85	6.11	5.98	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.75	-0.25	14.20	14.88	14.70	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	-0.25	8.35	8.76	8.72	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	-0.25	3.20	3.16	3.12	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.75	4.25	3.75	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.25	-0.25	7.15	6.25	4.88	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.495	-1.60	1.505	1.470	1.449	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.630	-2.70	1.648	1.612	1.575	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.697	-3.00	1.720	1.691	1.654	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.752	-4.80	1.787	1.781	1.731	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.867	-4.00	1.899	1.896	1.852	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.960	-3.70	1.992	1.987	1.930	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.136	-3.80	2.170	2.164	2.115	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.252	-4.00	2.290	2.290	2.235	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.353	-3.40	2.372	2.365	2.315	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	109.24	0.13	109.12	109.61	109.12
LKTb	124.40	0.40	123.98	124.46	123.98

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	3.50	0.60	3.19	4.83	4.72	9.00	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	-3.25	1.20	-4.26	-2.79	-1.92	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-5.95	0.75	-6.70	-5.65	-5.52	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-3.95	2.05	-5.37	-6.36	-5.83	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-9.95	1.50	-11.23	-12.33	-12.80	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-15.00	0.95	-16.12	-17.13	-16.29	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-26.85	1.05	-28.07	-28.70	-28.81	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-30.45	1.00	-31.70	-32.53	-32.04	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-33.30	0.15	-32.79	-33.77	-35.16	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1128.20 (+0.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-62.00	0.50	1Y	0.9100	-0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	7.00	-1.50	
-65.75	0.00	1.5Y	0.9400	-1.50	1.2750	0.8100	2*3Y	11.00	0.00	
-65.75	0.25	2Y	0.9800	-2.00	1.2250	0.7950	2*5Y	32.50	-0.50	
-62.25	0.75	3Y	1.0900	-2.00	1.3150	0.7350	3*4Y	11.00	0.00	
-56.75	0.50	4Y	1.2000	-2.00	1.3750	0.6900	3*5Y	21.50	-0.50	
-50.50	0.25	5Y	1.3050	-2.50	1.4350	0.6600	4*5Y	10.50	-0.50	
-44.25	0.25	7Y	1.4250	-2.50	1.4500	0.6550	5*7Y	12.00	0.00	
-38.75	1.00	10Y	1.5600	-2.00	1.9050	0.6300	5*10Y	25.50	0.50	

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	1.3377	0.39	1.3338	1.3051	1.3339	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1676	-3.15	2.1991	2.1677	2.2140	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	-0.3593	3.39	-0.3932	-0.4199	-0.4011	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0844	0.85	-0.0929	-0.1243	-0.0930	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	31.00	-0.75	31.75	31.75	32.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	55.50	-1.00	56.50	56.70	57.20	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	82.99	-3.54	86.53	86.26	88.01	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS	Lv.			ODD Tenor						
06M	42 / 42.25 / 42.75									
09M										
01Y	52.25 / 52.5 / 52.75									
1.5Y										
02Y	63 / 63.25 / 63.5			SPRD	6*12M 10 / 10.25					
03Y	71.25				1*2Y 11					
04Y					2*7Y 22					
05Y	80.25 / 80.5 / 81 / 81.25									
07Y										
10Y										
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	2*4Y 22									
TODAY KRX CCP				전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	102 건			15	87	63	60	52	56	69
금 액	28,568 억원			4,104	24,464	15,262	25,190	11,940	12,085	17,993

장중동향
 채권시장, 숏컷버로 추측되는 외인의 3년 국채선물 대량 매수로 국고채 금리 하락 마감.
 개장 후 9시 11분 경부터, 외인이 3년 국채선물을 2만여계약 가량을 시장가에 매수하면서 109.61까지 가격 급등. 그 영향으로 10년 국채선물도 급등.

IRS, 외인의 3선 대량 매수 영향을 받아 전구간 금리 하락. 커브 플래트닝.
 장중 금리가 많이 빠졌다가, 장 막판 비디쉬한 분위기를 보이면서 낙폭 일부 만회.
 주로 2Y,3Y,5Y이 거래되었으며, 7Y,10Y이나 12Y쪽에서도 수요가 있었음.
 CRS도 전구간 금리 하락.