

IPS Daily Morning Brief

2017-08-29

종가 기준일 2017-08-28

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4350	0.25	1.4380	1.4298	1.4150	1.5775	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4875	0.25	1.4920	1.4768	1.4575	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5325	0.25	1.5370	1.5203	1.4981	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5975	0.00	1.6050	1.5873	1.5574	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6375	0.00	1.6510	1.6366	1.6010	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7100	-0.25	1.7295	1.7195	1.6745	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7650	-0.25	1.7820	1.7748	1.7263	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8075	-0.25	1.8260	1.8183	1.7695	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8650	-0.25	1.8835	1.8791	1.8289	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9450	-0.25	1.9660	1.9663	1.9158	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9750	-0.25	1.9975	1.9978	1.9469	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9925	-0.25	2.0135	2.0093	1.9533	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0175	-0.25	2.0380	2.0299	1.9650	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.25	0.00	5.40	4.70	4.25	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.50	0.00	4.50	4.35	4.07	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	10.50	-0.25	11.40	11.64	10.28	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.25	-0.25	7.85	8.29	7.35	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.75	-0.25	13.10	13.81	12.53	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.00	-0.25	17.50	18.16	16.85	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.00	5.25	5.53	5.18	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	0.00	9.65	9.88	9.50	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.00	4.40	4.35	4.32	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.75	0.00	5.75	6.09	5.95	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.75	0.00	14.00	14.80	14.64	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	0.00	8.25	8.71	8.69	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.15	3.15	3.11	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.75	4.30	3.75	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	7.25	0.00	7.20	6.36	4.92	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.497	0.20	1.504	1.474	1.450	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.630	0.00	1.645	1.618	1.576	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.700	0.30	1.717	1.695	1.656	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.760	0.80	1.782	1.783	1.733	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.870	0.30	1.892	1.897	1.854	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.962	0.20	1.985	1.989	1.932	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.136	0.00	2.161	2.166	2.116	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.250	-0.20	2.279	2.291	2.236	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.350	-0.30	2.367	2.367	2.315	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.39	0.00
CALL	1.23	0.01

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.26	0.02	109.21	109.27	109.21
LKTB	124.45	0.05	124.25	124.47	124.25

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	3.55	0.05	3.34	4.64	4.77	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-3.25	0.00	-4.02	-3.05	-1.90	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-6.25	-0.30	-6.58	-5.80	-5.52	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-5.00	-1.05	-5.23	-6.36	-5.84	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-10.50	-0.55	-11.04	-12.25	-12.76	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-15.45	-0.45	-15.92	-17.08	-16.29	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-27.10	-0.25	-27.77	-28.67	-28.76	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-30.50	-0.05	-31.26	-32.49	-31.98	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-33.25	0.05	-32.94	-33.74	-35.00	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1121.00 (-7.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-62.25	-0.25	1Y	0.9100	0.00	1.3900	0.7650	1*2Y	8.00	1.00		
-65.25	0.50	1.5Y	0.9450	0.50	1.2600	0.8100	2*3Y	10.50	-0.50		
-64.75	1.00	2Y	0.9900	1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	31.00	-1.50		
-61.50	0.75	3Y	1.0950	0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	10.50	-0.50		
-56.50	0.25	4Y	1.2000	0.00	1.3750	0.6900	3*5Y	20.50	-1.00		
-50.75	-0.25	5Y	1.3000	-0.50	1.4350	0.6600	4*5Y	10.00	-0.50		
-44.50	-0.25	7Y	1.4200	-0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	12.00	0.00		
-39.00	-0.25	10Y	1.5550	-0.50	1.9050	0.6300	5*10Y	25.50	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	1.3335	-0.42	1.3377	1.3338	1.3051	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1571	-1.05	2.1676	2.1991	2.1677	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	-0.3665	-0.72	-0.3593	-0.3932	-0.4199	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0929	-0.85	-0.0844	-0.0929	-0.1243	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	30.75	-0.25	31.00	31.75	31.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	55.00	-0.50	55.50	56.50	56.70	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	82.36	-0.63	82.99	86.53	86.26	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS	Lv.				ODD Tenor	6y / 84.25				
06M										
09M										
01Y	53.25	53.5								
1.5Y										
02Y	64				SPRD	1*2/10.5				
03Y	71.5	71.75				1*3/18.25				
04Y						6*7/2.75				
05Y						10*20/7.25				
07Y	87									
10Y										
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			47 건	-55	102	87	63	60	52	
금 액			8,140 억원	-20,428	28,568	24,464	15,262	25,190	11,940	

장중동향
 IRS는 이번 주 금통위를 앞두고 한산한 장세 속 보합권에 머물렀음. 3년이상은 소폭 하락 마감.
 미국재료가 나와서 오늘쯤에는 방향성을 보일 것으로 예상되었으나 방향성은 없었음. 이번 주 금통위에서 소수의견이 나올지를 두고 눈치보기 장세가 이어지는 것 같아보임.
 북한이 단거리 미사일도 발사한 상황에서 소수의견이 나오면 투자심리가 무너질 수 있는 상황으로 금통위가 소수의견을 내지는 않을 것으로 예상됨.

CRS 금리는 장.단기 구간에서 엇갈린 모습을 보이며 마감.(2년과 3년은 각각 1bp와 0.5bp 상승, 5·7·10년은 0.5bp씩 떨어짐)