

IPS Daily Morning Brief

2017-09-01

종가 기준일 2017-08-31

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4200	0.50	1.4255	1.4314	1.4164	1.5625	1.2875	2.7575	1.2875
9M	1.4625	0.25	1.4745	1.4794	1.4602	1.5450	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5075	0.00	1.5200	1.5240	1.5019	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5725	0.00	1.5860	1.5916	1.5627	1.6150	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6225	0.25	1.6300	1.6404	1.6070	1.6700	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6975	0.25	1.7045	1.7229	1.6815	1.7600	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7550	0.50	1.7600	1.7779	1.7334	1.8125	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8000	0.75	1.8030	1.8210	1.7766	1.8600	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8600	0.75	1.8620	1.8815	1.8356	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9400	1.00	1.9415	1.9673	1.9218	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9700	1.00	1.9715	1.9984	1.9525	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9825	0.50	1.9880	2.0115	1.9593	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0025	0.75	2.0095	2.0330	1.9717	2.0700	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	4.25	-0.25	4.90	4.80	4.38	5.75	-6.00	5.75	-6.25
9*12M	4.50	-0.25	4.55	4.46	4.18	4.75	-4.00	4.75	-4.50
1*2Y	11.50	0.25	11.00	11.64	10.51	12.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.50	0.00	7.45	8.25	7.44	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.25	0.25	13.00	13.75	12.64	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.75	0.50	17.30	18.06	16.96	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	0.25	5.55	5.50	5.20	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.50	9.85	9.81	9.52	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	0.25	4.30	4.31	4.32	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.00	0.00	5.90	6.05	5.90	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	14.00	0.25	13.85	14.63	14.52	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.00	0.25	7.95	8.58	8.62	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.00	0.00	3.00	3.11	3.07	5.25	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	-0.50	4.65	4.43	3.75	7.75	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	6.25	-0.25	6.80	6.58	4.99	11.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.472	-1.50	1.491	1.486	1.453	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.600	-1.20	1.621	1.629	1.581	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.680	-0.70	1.694	1.703	1.662	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.747	-0.30	1.756	1.787	1.739	1.831	1.200	3.120	1.200
4Y	1.865	0.30	1.869	1.899	1.859	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.967	0.70	1.965	1.992	1.939	2.032	1.217	3.430	1.217
7Y	2.149	1.20	2.141	2.169	2.122	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.267	1.70	2.255	2.292	2.240	2.332	1.355	3.750	1.355
20Y	2.340	0.50	2.345	2.368	2.317	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.38	0.00
CALL	1.23	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.28	0.01	109.27	109.32	109.22
LKTB	124.30	-0.15	124.45	124.51	124.22

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	1.50	2.90	3.77	4.87	9.00	-17.75	11.50	-17.75
1.5Y	-2.75	1.20	-3.54	-3.78	-1.81	2.40	-19.10	8.75	-19.10
2Y	-5.75	0.95	-6.42	-6.25	-5.46	-1.35	-25.15	9.00	-25.15
3Y	-4.95	0.55	-5.13	-6.38	-5.80	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.00	0.20	-10.88	-12.15	-12.55	-3.20	-30.35	3.25	-30.35
5Y	-16.70	0.05	-16.18	-17.08	-16.21	-2.25	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-28.90	-0.45	-27.88	-28.76	-28.61	-7.50	-37.65	-2.50	-37.65
10Y	-32.70	-0.70	-31.33	-32.45	-31.83	-12.95	-38.70	0.00	-38.70
20Y	-33.75	0.25	-33.55	-33.51	-34.53	-13.95	-48.50	-1.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1127.80 (+3.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-60.25	1.50	1Y	0.9050	1.50	1.3900	0.7650	1*2Y	6.50	-0.50	
-63.75	1.50	1.5Y	0.9350	1.50	1.2600	0.8100	2*3Y	10.00	0.00	
-65.25	0.75	2Y	0.9700	1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	28.50	0.00	
-62.75	0.75	3Y	1.0700	1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	10.50	0.00	
-58.00	0.50	4Y	1.1750	1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	18.50	0.00	
-54.50	0.25	5Y	1.2550	1.00	1.4350	0.6600	4*5Y	8.00	0.00	
-49.50	0.25	7Y	1.3650	1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	11.00	0.00	
-44.00	0.00	10Y	1.5000	1.00	1.9050	0.6300	5*10Y	24.50	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	1.3295	0.01	1.3294	1.3174	1.3335	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.1187	-1.49	2.1336	2.1362	2.1571	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	-0.3505	0.71	-0.3576	-0.3896	-0.3665	0.1019	-0.7720	0.1019	-2.6400
10Y	-0.1483	-3.19	-0.1164	-0.1188	-0.0929	0.4740	-0.1483	0.4740	-1.2200

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	31.75	0.75	31.00	31.25	30.75	41.50	2.75	70.25	2.75
KTb 2*10Y	58.70	2.40	56.30	54.80	55.00	68.70	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	78.92	-1.50	80.42	81.88	82.36	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M	42.5								
09M									
01Y	50.5								
1.5Y	56.75								
02Y	62 / 62.25								
03Y		SPRD	3*10Y		24.25				
04Y			10*15Y		4.25				
05Y									
07Y									
10Y	94 / 94.5								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	70 건	-38	108	98	47	102	87	63	
금 액	29,913 억원	-3,082	32,995	27,140	8,140	28,568	24,464	15,262	

장중동향

국고채 금리, 금투협에서 시장의 예상대로 연 1.25% 금리 동결 후 기자회견에 따라 등락을 거듭하다 보합권에서 마감. 금투협은 우리 경제가 견실한 성장세를 이어간다면, 성장 흐름이 7월 전망경로와 대체로 부합할 것으로 예상.

IRS, 대부분 구간에서 금리 상승 마감.

전반적으로 조용한 상황 속에서 단기물을 중심으로 거래. 4Y까지 비드, 중장기 테너는 오퍼가 많은 양상.

그나마 1-1.5Y 구간 위주로 오퍼가 있어 호가가 대치되면서 거래.

CRS, 전구간 금리 상승. 한산한 분위기 속 2Y를 중심으로 일부 거래.

오전에는 조용한 편이었고, 오후에 포지션 조정용으로 추측되는 거래가 잠시 있었음.