IPS Daily Morning Brief

2017-07-19

종가 기준일 2017-07-18

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4150	0.00	1.4145	1.4131	1.4101	1.5925	1.2875	2.7600	1.2875
9M	1.4650	0.00	1.4645	1.4586	1.4425	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5075	-0.25	1.5085	1.5011	1.4748	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5675	-0.25	1.5685	1.5626	1.5239	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6200	-0.25	1.6195	1.6035	1.5614	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.7000	-0.75	1.7015	1.6748	1.6294	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7525	-1.25	1.7555	1.7274	1.6812	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.8050	-1.50	1.8070	1.7714	1.7271	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8700	-1.50	1.8735	1.8298	1.7930	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9600	-1.50	1.9640	1.9149	1.8876	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9850	-1.50	1.9915	1.9433	1.9220	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9900	-1.50	1.9960	1.9444	1.9268	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	2.0000	-1.50	2.0060	1.9511	1.9300	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.00	0.00	5.00	4.55	3.25	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.25	-0.25	4.40	4.25	3.23	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.25	0.00	11.10	10.24	8.66	11.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	-0.50	8.20	7.13	6.80	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.25	-1.00	13.60	12.39	11.98	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.50	-1.25	18.75	16.79	16.58	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	-0.50	5.40	5.26	5.18	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.50	-0.75	10.55	9.66	9.77	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.25	-0.25	5.15	4.40	4.60	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.50	0.00	6.65	5.84	6.59	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.50	0.00	15.70	14.35	16.05	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.00	0.00	9.05	8.51	9.45	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.00	2.75	2.84	3.45	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.00	3.20	2.95	3.93	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	0.00	4.20	3.63	4.25	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.440	-0.50	1.445	1.448	1.447	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.557	-0.80	1.567	1.567	1.550	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.660	-0.10	1.662	1.654	1.623	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.747	-0.50	1.751	1.727	1.693	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.872	-1.00	1.875	1.852	1.820	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.945	-1.70	1.949	1.922	1.894	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.130	-2.00	2.135	2.112	2.098	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.260	-2.00	2.261	2.223	2.216	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.302	-2.30	2.309	2.296	2.324	2.430	1.430	3.943	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.39	0.00
CALL	1.24	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.20	0.02	109.21	109.24	109.20
LKTB	124.19	0.19	124.14	124.36	124.09

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	6.75	0.25	6.37	5.36	2.77	7.95	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.05	0.55	0.19	-0.48	-2.59	1.45	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.00	-0.15	-4.21	-5.04	-6.20	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-4.70	-0.25	-4.91	-5.19	-6.34	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-11.95	-0.25	-11.97	-12.50	-13.93	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-14.00	0.20	-14.18	-15.09	-16.72	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-26.00	0.50	-26.13	-28.24	-30.54	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-30.00	0.50	-29.68	-30.80	-32.88	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-30.20	0.80	-30.28	-34.49	-39.39	-13.95	-48.50	6.00	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-63.75	0.25
-62.75	0.25
-59.50	0.25
-55.50	0.75
-51.75	1.75
-50.00	3.00
-52.00	4.00
-52.50	4.00

CRS

USD/KRW 1123.10 (-5.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8700	0.00	1.4000	0.7650	1*2Y	15.50	0.00
1.5Y	0.9400	0.00	1.2850	0.8100	2*3Y	12.00	0.00
2Y	1.0250	0.00	1.2250	0.7950	2*5Y	28.00	1.50
3Y	1.1450	0.00	1.3150	0.7350	3*4Y	9.00	0.50
4Y	1.2350	0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	16.00	1.50
5Y	1.3050	1.50	1.4350	0.6600	4*5Y	7.00	1.00
7Y	1.3500	2.50	1.4500	0.6550	5*7Y	4.50	1.00
10Y	1.4350	2.50	1.9050	0.6300	5*10Y	13.00	1.00

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	1.3518	-0.39	1.3557	1.3637	1.3755	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2602	-5.51	2.3153	2.3349	2.3457	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	-0.3082	-0.29	-0.3053	-0.2933	-0.2845	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0002	3.51	-0.0353	-0.0879	-0.1037	0.1370	-0.4740	1.2400	-0.4740

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	34.00	-1.25	35.25	33.75	33.50	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	70.30	-1.20	71.50	68.20	67.20	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	90.84	-5.12	95.96	97.12	97.02	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	8Y 89.25
09M			
01Y	50.25		
1.5Y			
02Y	61 / 61.25	SPRD	2*5Y 18.75
03Y	69.5		3*8Y 20
04Y	75		2*3*4Y 2.75
05Y	79.75		
07Y	87		
10Y	95.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	55 건	17	38	37	85	81	74	81
금 액	10,260 억원	-1,315	11,575	11,724	24,855	21,155	17,914	21,840

장중동향

채권시장, 외인 국채선물 순매수에 힘입어 강세 마감. 장기물 강세가 두드러지면서 커브 플래트닝.

IRS, 현물시장에 연동하며 전구간 금리 하락. 특히 5년 이상 장기 테너가 상대적 금리 낙폭 확대. 커브 플래트닝.
ECB 통화정책회의 대기모드로 국채선물 움직임에 연동될 뿐 특이한 움직임은 없었음.
2y이 61(-1.25)~61.25(-1.00), 4y 75(-1.50)에 몇번 거래.

CRS, 중장기 테너 중심으로 금리 상승 마감.
한국수력원자력이 10년 만기 달러 채권 발행에 착수해 발행금리를 미국 국채 대비 120bp 부근으로 최초 제시.