IPS Daily Morning Brief

2017-07-21

종가 기준일 2017-07-20

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4075	-0.25	1.4125	1.4133	1.4096	1.5925	1.2875	2.7600	1.2875
9M	1.4575	-0.25	1.4625	1.4600	1.4431	1.5500	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.5000	-0.25	1.5060	1.5028	1.4764	1.5625	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5600	-0.50	1.5660	1.5650	1.5264	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.6100	-1.00	1.6180	1.6081	1.5646	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6900	-1.00	1.6990	1.6819	1.6336	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.7400	-1.00	1.7515	1.7358	1.6856	1.7925	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7875	-1.25	1.8025	1.7815	1.7319	1.8475	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8425	-1.75	1.8645	1.8409	1.7975	1.9250	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9325	-1.75	1.9545	1.9278	1.8922	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9575	-1.75	1.9805	1.9555	1.9261	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9625	-1.75	1.9855	1.9571	1.9309	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9725	-1.75	1.9955	1.9649	1.9348	2.0575	1.2150	3.8075	1.2150

6*9M	5.00	0.00	5.00	4.68	3.35	5.25	-6.00	5.25	-6.50
9*12M	4.25	0.00	4.35	4.28	3.33	4.75	-4.00	4.75	-5.75
1*2Y	11.00	-0.75	11.20	10.54	8.83	11.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	8.00	0.00	8.10	7.38	6.90	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	13.00	0.00	13.35	12.76	12.10	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.75	-0.25	18.45	17.34	16.73	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	5.25	5.39	5.20	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	-0.25	10.35	9.96	9.83	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	-0.25	5.10	4.58	4.63	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.50	-0.50	6.20	5.94	6.56	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	14.50	-0.50	15.20	14.63	16.03	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.00	0.00	9.00	8.69	9.47	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.00	2.60	2.78	3.39	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.00	3.10	2.94	3.87	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.00	0.00	4.10	3.71	4.26	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.436	-0.40	1.441	1.447	1.446	1.723	1.237	2.750	1.237
1.5Y	1.551	-0.50	1.559	1.566	1.550	1.768	1.232	2.890	1.232
2Y	1.652	-0.80	1.658	1.656	1.625	1.830	1.225	2.990	1.225
3Y	1.737	-1.00	1.746	1.731	1.695	1.830	1.200	3.120	1.200
4Y	1.860	-1.20	1.871	1.859	1.823	1.975	1.232	3.340	1.232
5Y	1.932	-1.30	1.945	1.930	1.898	2.000	1.217	3.430	1.217
7Y	2.111	-1.70	2.128	2.120	2.101	2.221	1.270	3.590	1.270
10Y	2.235	-2.20	2.256	2.234	2.220	2.321	1.355	3.750	1.355
20Y	2.300	0.00	2.305	2.304	2.325	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	109.23	0.04	109.19	109.24	109.18
LKTB	124.47	0.23	124.22	124.47	124.21

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	6.40	0.15	6.48	5.57	3.08	7.95	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	0.90	0.00	0.72	-0.09	-2.34	1.45	-19.10	9.75	-19.10
2Y	-4.20	-0.20	-4.00	-4.76	-6.04	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	-4.70	0.00	-4.66	-4.93	-6.16	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	-12.00	0.20	-11.91	-12.35	-13.79	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	-14.45	0.05	-14.23	-14.82	-16.58	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	-26.85	-0.05	-26.39	-27.93	-30.34	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	-30.25	0.45	-30.13	-30.62	-32.77	-12.95	-38.70	6.00	-38.70
20Y	-32.75	-1.75	-30.93	-33.87	-39.00	-13.95	-48.50	6.00	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-60.50	0.75
-60.50	1.00
-58.00	0.50
-55.00	-0.50
-50.50	0.00
-49.75	-1.75
-49.75	0.25
-48.25	1.75

CRS

USD/KRW 1125.50 (+4.90)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8950	0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	13.50	-1.00
1.5Y	0.9550	0.50	1.2850	0.8100	2*3Y	11.00	-1.00
2Y	1.0300	-0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	26.00	-2.50
3Y	1.1400	-1.50	1.3150	0.7350	3*4Y	9.50	0.50
4Y	1.2350	-1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	15.00	-1.50
5Y	1.2900	-3.00	1.4350	0.6600	4*5Y	5.50	-2.00
7Y	1.3450	-1.50	1.4500	0.6550	5*7Y	5.50	1.50
10Y	1.4500	0.00	1.9050	0.6300	5*10Y	16.00	3.00

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	1.3521	-0.8	1.3601	1.3518	1.3557	1.7169	0.5600	1.7169	0.2000
10Y	2.2583	-1.34	2.2717	2.2602	2.3153	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	-0.2999	0	-0.2999	-0.3082	-0.3053	0.1019	-0.8220	0.1019	-2.6400
10Y	-0.0233	-0.86	-0.0147	-0.0002	-0.0353	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	32.25	-0.75	33.00	34.00	35.25	41.50	2.75	70.25	2.75
KTB 2*10Y	68.40	-1.70	70.10	70.30	71.50	73.90	11.80	90.00	11.80
UST 2*10Y	90.62	-0.54	91.16	90.84	95.96	135.50	41.06	264.00	41.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	56		
02Y	61	SPRD	
03Y	69		
04Y	74		
05Y			
07Y			
10Y	93.5 / 94.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y 89.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	47 건	-34	81	55	38	37	85	81
금 액	9,778 억원	-4,072	13,850	10,260	11,575	11,724	24,855	21,155

장중동향

전날 금리가 상승한데에 따른 되돌림으로 보이는 매수세로 강세. 시장은 ECB통화정책 회의를 앞두고 대기 모드.

IRS역시 짙은 관망세 속에 오전에는 거의 거래가 없는 모습. 오후들어서 선물이 재차 강해지면서 레벨이 낮아지고 커브도 플랫되며 마감.

CRS는 단기쪽이 소폭상승하고 2~7년까지 하락 마감.