# IPS Daily Closing Brief

**2017-05-29**

| IRS | | | | 91d CD | 1.38 | ( 0.00) | CALL | 1.22 | (-0.01) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Tenor | Lv. | 전일비 | 5MA | 20MA | 60MA | 1Y Max | 1Y Min | 3Y Max | 3Y Min |
| 6M | 1.3975 | -0.25 | 1.4000 | 1.4135 | 1.4518 | 1.6600 | 1.2875 | 2.8000 | 1.2875 |
| 9M | 1.4200 | -0.25 | 1.4225 | 1.4401 | 1.4700 | 1.6500 | 1.2500 | 2.7900 | 1.2500 |
| 1Y | 1.4475 | -0.25 | 1.4490 | 1.4674 | 1.4879 | 1.6475 | 1.2200 | 2.8150 | 1.2200 |
| 1.5Y | 1.4900 | 0.00 | 1.4910 | 1.5120 | 1.5268 | 1.6600 | 1.1900 | 2.8725 | 1.1900 |
| 2Y | 1.5275 | 0.00 | 1.5275 | 1.5495 | 1.5624 | 1.6775 | 1.1675 | 2.9350 | 1.1675 |
| 3Y | 1.5950 | 0.25 | 1.5955 | 1.6214 | 1.6292 | 1.7350 | 1.1550 | 3.0650 | 1.1550 |
| 4Y | 1.6475 | 0.50 | 1.6475 | 1.6764 | 1.6839 | 1.7925 | 1.1575 | 3.1875 | 1.1575 |
| 5Y | 1.6975 | 0.50 | 1.6975 | 1.7286 | 1.7343 | 1.8475 | 1.1575 | 3.3050 | 1.1575 |
| 7Y | 1.7675 | 0.75 | 1.7685 | 1.8031 | 1.8113 | 1.9350 | 1.1675 | 3.4625 | 1.1675 |
| 10Y | 1.8675 | 0.50 | 1.8720 | 1.9098 | 1.9116 | 2.0400 | 1.2125 | 3.6250 | 1.2125 |
| 12Y | 1.9050 | 0.50 | 1.9080 | 1.9473 | 1.9487 | 2.0950 | 1.2150 | 3.6575 | 1.2150 |
| 15Y | 1.9150 | 0.50 | 1.9165 | 1.9525 | 1.9508 | 2.1225 | 1.2150 | 3.6675 | 1.2150 |
| 20Y | 1.9200 | 0.25 | 1.9225 | 1.9535 | 1.9360 | 2.1525 | 1.2150 | 3.8075 | 1.2150 |
| 6*9M | 2.25 | 0.00 | 2.25 | 2.66 | 1.81 | 3.25 | -6.00 | 4.25 | -6.50 |
| 9*12M | 2.75 | 0.00 | 2.65 | 2.73 | 1.79 | 3.25 | -4.00 | 4.50 | -5.75 |
| 1*2Y | 8.00 | 0.25 | 7.85 | 8.21 | 7.45 | 9.75 | -5.50 | 16.25 | -8.75 |
| 2*3Y | 6.75 | 0.25 | 6.80 | 7.19 | 6.68 | 8.50 | -1.75 | 15.00 | -1.75 |
| 2*4Y | 12.00 | 0.50 | 12.00 | 12.69 | 12.15 | 15.25 | -1.75 | 28.25 | -1.75 |
| 2*5Y | 17.00 | 0.50 | 17.00 | 17.91 | 17.20 | 21.00 | -1.75 | 39.25 | -1.75 |
| 3*4Y | 5.25 | 0.25 | 5.20 | 5.50 | 5.47 | 7.75 | -0.50 | 14.00 | -0.50 |
| 3*5Y | 10.25 | 0.25 | 10.20 | 10.73 | 10.51 | 14.00 | -0.50 | 25.00 | -0.50 |
| 4*5Y | 5.00 | 0.00 | 5.00 | 5.23 | 5.04 | 6.25 | -0.25 | 11.75 | -0.25 |
| 5*7Y | 7.00 | 0.25 | 7.10 | 7.45 | 7.70 | 10.50 | 0.25 | 16.25 | 0.25 |
| 5*10Y | 17.00 | 0.00 | 17.45 | 18.11 | 17.73 | 22.25 | 3.75 | 32.25 | 3.75 |
| 7*10Y | 10.00 | -0.25 | 10.35 | 10.66 | 10.03 | 12.75 | 3.00 | 16.75 | 3.00 |
| 10*12Y | 3.75 | 0.00 | 3.60 | 3.75 | 3.71 | 5.50 | -0.25 | 7.75 | -0.25 |
| 10*15Y | 4.75 | 0.00 | 4.45 | 4.28 | 3.92 | 8.25 | -0.75 | 15.00 | -0.75 |
| 10*20Y | 5.25 | -0.25 | 5.05 | 4.38 | 2.45 | 11.25 | -11.00 | 31.00 | -11.00 |

| BOND | | | BOND SWAP SPRD (1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준) | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Tenor | Lv. | 전일비 | Tenor | Lv. | 전일비 | 1Y Max | 1Y Min | 3Y Max | 3Y Min |
| 1Y | 1.4520 | 0.10 | 1Y | -0.45 | -0.35 | 5.75 | -17.75 | 13.00 | -17.75 |
| 1.5Y | 1.5370 | 0.00 | 1.5Y | -4.70 | 0.00 | -0.10 | -19.10 | 9.75 | -19.10 |
| 2Y | 1.6100 | 0.10 | 2Y | -8.25 | -0.10 | -1.35 | -25.15 | 9.50 | -25.15 |
| 3Y | 1.6740 | -0.30 | 3Y | -7.90 | 0.55 | 4.75 | -19.50 | 11.00 | -19.50 |
| 4Y | 1.8090 | -0.30 | 4Y | -16.15 | 0.80 | -3.20 | -30.35 | 5.75 | -30.35 |
| 5Y | 1.8900 | -0.70 | 5Y | -19.25 | 1.20 | -2.25 | -27.25 | 8.50 | -27.25 |
| 7Y | 2.1030 | -0.70 | 7Y | -33.55 | 1.45 | -7.50 | -37.65 | 2.00 | -37.65 |
| 10Y | 2.2350 | -0.90 | 10Y | -36.75 | 1.40 | -12.95 | -38.70 | 6.00 | -38.70 |

| BASIS SWAP | | | CRS | | | | USD/KRW | 1120.70 | (+4.20) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Tenor | Lv. | 전일비 | Lv. | 전일비 | 1Y Max | 1Y Min | SPRD | Lv. | 전일비 |
| 1Y | -58.75 | -0.25 | 0.8600 | -0.50 | 1.4000 | 0.7650 | 1*2Y | 12.00 | 0.00 |
| 1.5Y | -56.50 | -0.50 | 0.9250 | -0.50 | 1.2850 | 0.8100 | 2*3Y | 11.00 | 0.50 |
| 2Y | -54.75 | -0.50 | 0.9800 | -0.50 | 1.2250 | 0.7950 | 2*5Y | 20.00 | 0.50 |
| 3Y | -50.50 | -0.25 | 1.0900 | 0.00 | 1.3250 | 0.7350 | 3*4Y | 5.50 | 0.00 |
| 4Y | -50.25 | -0.50 | 1.1450 | 0.00 | 1.3750 | 0.6900 | 3*5Y | 9.00 | 0.00 |
| 5Y | -51.75 | -0.50 | 1.1800 | 0.00 | 1.4350 | 0.6600 | 4*5Y | 3.50 | 0.00 |
| 7Y | -55.75 | -0.75 | 1.2100 | 0.00 | 1.4600 | 0.6550 | 5*7Y | 3.00 | 0.00 |
| 10Y | -50.25 | -0.50 | 1.3650 | 0.00 | 1.9050 | 0.6300 | 5*10Y | 18.50 | 0.00 |

## TODAY DEAL LEVEL

| IRS | Lv. | | |
|---|---|---|---|
| 06M | | ODD Tenor | |
| 09M | | | |
| 01Y | 44.75 / 45 | | |
| 1.5Y | 49 | | |
| 02Y | 52.75 / 53 | SPRD | 1*2Y 08 |
| 03Y | 59.5 / 59.75 | | 1.5*2Y 04 |
| 04Y | | | 4*7Y 12.25 |
| 05Y | | | 10*20Y 5.25 / 5.5 / 5.75 |
| 07Y | 76 | | |
| 10Y | 86.75 / 87.25 | | |
| 12Y | | | |
| 15Y | | | |
| 20Y | | | |
| CRS | | | |

| TODAY KRX CCP | | 국채선물 | Lv. | 전일비 | 시 | 고 | 저 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 거래현황 | 63건 (-20건) | KTB | 109.49 | 0.02 | 109.46 | 109.51 | 109.46 |
| 금 액 | 15,145억원 (-1,227원) | LKTB | 124.73 | 0.08 | 124.63 | 124.79 | 124.53 |

## 장중동향

금일 채권은 금통위가 끝나고 특별한 재료가 없는 가운데 외국인의 움직임에 따라 등락하는 장세. 특별한 이슈없이 강보합 마감.

IRS는 장이 조용한 가운데 거래는 꾸준히 발생. 장초반부터 10년가격이 초이스붙는 등 활발. 역외끼리의 거래가 많이 보였고, on/off로 역외/온쇼 거래도 많았던걸로 보임. 5년, 10년은 역시나 본드스왑 들어가는 비드가 눈에 띄었고, 10*20년 초장기 스플은 5.25 5.5 5.75 레벨로 거래형성. 국채선물이 강보합으로 마감된데 비해 스왑은 1년이하로는 0.25bp하락했지만 그 뒤로는 소폭 상승하며 커브 스팁 마감.

CRS는 단기구간 소폭하락 마감.

## ETC