IPS Daily Closing Brief

2017-06-02

IRS				91d CD	1.38	(0.00)	CALL	1.24	(+0.02)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3900	-0.25	1.3940	1.4056	1.4429	1.6550	1.2875	2.7950	1.2875
9M	1.4100	-0.25	1.4170	1.4308	1.4624	1.6350	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4375	-0.25	1.4445	1.4583	1.4817	1.6325	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.4750	-0.50	1.4870	1.5024	1.5213	1.6450	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5125	-0.50	1.5265	1.5411	1.5573	1.6600	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.5775	-0.75	1.5965	1.6145	1.6252	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6350	-0.50	1.6515	1.6701	1.6800	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.6825	-0.50	1.7005	1.7221	1.7301	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7575	-0.50	1.7745	1.7973	1.8068	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8550	-0.75	1.8755	1.9028	1.9071	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.8925	-0.75	1.9130	1.9395	1.9444	2.0800	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9025	-0.75	1.9230	1.9460	1.9478	2.1075	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9075	-0.75	1.9280	1.9489	1.9363	2.1375	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	2.00	0.00	2.30	2.51	1.95	3.25	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	2.75	0.00	2.75	2.75	1.93	3.25	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	7.50	-0.25	8.20	8.29	7.57	9.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	6.50	-0.25	7.00	7.34	6.78	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.25	0.00	12.50	12.90	12.26	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.00	0.00	17.40	18.10	17.28	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	0.25	5.50	5.56	5.48	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.50	0.25	10.40	10.76	10.49	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	0.00	4.90	5.20	5.01	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.50	0.00	7.40	7.51	7.67	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	17.25	-0.25	17.50	18.06	17.70	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.75	-0.25	10.10	10.55	10.03	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.68	3.73	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.75	4.33	4.07	8.25	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.00	5.25	4.61	2.93	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	1.4310	0.00	1Y	0.65	-0.25	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5170	-0.10	1.5Y	-4.20	-0.40	-0.10	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.5770	-1.00	2Y	-6.45	0.50	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6250	-1.50	3Y	-4.75	0.75	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.7670	-1.30	4Y	-13.20	0.80	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8420	-1.50	5Y	-15.95	1.00	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0590	-1.20	7Y	-30.15	0.70	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.1970	-1.30	10Y	-34.20	0.55	-12.95	-38.70	6.00	-38.70

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1121.80	(-0.20)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-62.25	-1.25	0.8150	-1.50	1.4000	0.7650	1*2Y	13.00	0.00
1.5Y	-59.50	-1.00	0.8800	-1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	10.00	0.50
2Y	-56.75	-1.00	0.9450	-1.50	1.2250	0.7950	2*5Y	17.50	0.50
3Y	-53.25	-0.25	1.0450	-1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	6.00	0.00
4Y	-53.00	-0.50	1.1050	-1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	7.50	0.00
5Y	-56.25	-0.50	1.1200	-1.00	1.4350	0.6600	4*5Y	1.50	0.00
7Y	-60.75	-0.50	1.1500	-1.00	1.4500	0.6550	5*7Y	3.00	0.00
10Y	-56.50	-0.25	1.2900	-1.00	1.9050	0.6300	5*10Y	17.00	0.00

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	44		
1.5Y			
02Y	51.75 / 51.25	SPRD	1*2y 08.25
03Y	58.5		10*20y 03.75
04Y	64.75		
05Y	68.75 / 68.25		
07Y			
10Y	85.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3y 5.5		

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	48건 (-14건)	KTB	109.65	0.04	109.59	109.69	109.56
금 액	12,010억원 (-8,670억원)	LKTB	125.14	1.09	124.97	125.06	124.92

장중동향

금일 스왑시장은 오전에 한산한 모습을 보이다가 오후 2시30분부터 선물이 변동성이 생기면서 거래가 활발해짐. 외인이 6거래일 연속 3년.10년 국채선물을 순매수하면서 강세장을 이끌었음.

IRS는 외인의 선·현물 대량 순매수에 따른 현물 금리에 연동되는 모습을 보이며 전체적으로 하락 마감.

CRS는 FX 스왑이 하락한 영향으로 오퍼가 우위를 보임. 금리 하락 마감.

ETC