IPS Daily Closing Brief

2017-06-16

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	1.4075	0.75	1.4005	1.3971	1.4268	1.6550	1.2875	2.7950	1.2875
9M	1.4400	0.75	1.4325	1.4216	1.4480	1.6200	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4800	1.50	1.4665	1.4496	1.4693	1.6050	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5250	1.50	1.5120	1.4914	1.5094	1.6075	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5575	1.75	1.5450	1.5265	1.5441	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6150	2.00	1.6045	1.5910	1.6097	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6550	2.50	1.6480	1.6414	1.6619	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.6900	2.75	1.6855	1.6866	1.7098	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7400	3.50	1.7410	1.7540	1.7832	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8225	4.00	1.8270	1.8506	1.8820	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.8575	4.00	1.8625	1.8873	1.9194	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.8700	4.50	1.8710	1.8959	1.9245	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.8700	4.50	1.8755	1.9011	1.9207	2.0500	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	3.25	0.00	3.20	2.45	2.12	3.25	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	4.00	0.75	3.40	2.80	2.13	4.00	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	7.75	0.25	7.85	7.69	7.48	9.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	5.75	0.25	5.95	6.45	6.56	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	9.75	0.75	10.30	11.49	11.78	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	13.25	1.00	14.05	16.01	16.57	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	4.00	0.50	4.35	5.04	5.22	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	7.50	0.75	8.10	9.56	10.01	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.50	0.25	3.75	4.53	4.79	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	5.00	0.75	5.55	6.74	7.33	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	13.25	1.25	14.15	16.40	17.22	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.25	0.50	8.60	9.66	9.88	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.00	3.55	3.66	3.74	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.50	4.40	4.53	4.25	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.75	0.50	4.85	5.05	3.87	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	1.4370	0.50	1Y	4.30	1.00	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5700	0.80	1.5Y	-4.50	0.70	-0.10	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.6220	0.60	2Y	-6.45	1.15	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6970	1.70	3Y	-8.20	0.30	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.8000	1.80	4Y	-14.50	0.70	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8700	2.00	5Y	-18.00	0.75	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0530	2.90	7Y	-31.30	0.60	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.1590	3.40	10Y	-33.65	0.60	-12.95	-38.70	6.00	-38.70

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1134.10	(+10.00)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-62.50	1.50	0.8550	3.00	1.4000	0.7650	1*2Y	13.00	-1.00
1.5Y	-61.00	1.00	0.9150	2.50	1.2850	0.8100	2*3Y	9.00	0.00
2Y	-57.25	0.25	0.9850	2.00	1.2250	0.7950	2*5Y	20.00	0.00
3Y	-54.00	0.00	1.0750	2.00	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00
4Y	-50.50	-0.50	1.1500	2.00	1.3750	0.6900	3*5Y	11.00	0.00
5Y	-50.50	-0.75	1.1850	2.00	1.4350	0.6600	4*5Y	3.50	0.00
7Y	-52.50	-1.50	1.2150	2.00	1.4500	0.6550	5*7Y	3.00	0.00
10Y	-51.25	-2.00	1.3100	2.00	1.9050	0.6300	5*10Y	12.50	0.00

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	
09M	44.25		
01Y	48 / 47.25 / 47.75		
1.5Y	52.25		
02Y	55 / 55.25 / 55.5 / 55.75	SPRD	9*18m @ 08
03Y	61.25 / 61		
04Y			1*2y @ 7.75
05Y	68 / 68.5		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	103건 (-2건)	KTB	109.53	-0.05	109.55	109.55	109.51
금 액	31,553억원 (+9,747억원)	LKTB	125.40	-0.43	125.67	125.74	125.40

장중동향

IRS 금리 상승. 전일 미 FOMC 이후 금리가 하락했던 데 따른 되돌림이 연출됐다. 역외를 중심으로 비드가 나오면서 금리가 상승했고 장기물의 금리 상승이 두드러지면서 수익률곡선은 가팔라졌다.

CRS는 에셋스와프 오퍼에도 전반적으로 비드가 더 우세했고 상승 마감.

ETC