IPS Daily Closing Brief

2017-05-02

IRS				91d CD	1.41	(0.00)	CALL	1.22	(0.00)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4225	0.00	1.4255	1.4334	1.4724	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875
9M	1.4525	0.25	1.4545	1.4536	1.4846	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500
1Y	1.4825	0.50	1.4810	1.4700	1.4967	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200
1.5Y	1.5300	1.00	1.5255	1.5084	1.5304	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5675	1.25	1.5600	1.5419	1.5631	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6375	2.00	1.6240	1.6033	1.6263	1.7850	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6925	2.25	1.6765	1.6540	1.6812	1.8450	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7475	2.75	1.7265	1.7010	1.7313	1.9050	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8250	3.50	1.7980	1.7781	1.8085	1.9925	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9300	3.50	1.9035	1.8744	1.9087	2.1025	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9700	3.50	1.9440	1.9140	1.9441	2.1575	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9750	3.50	1.9490	1.9188	1.9439	2.1850	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9725	3.50	1.9465	1.9110	1.9165	2.2175	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	3.00	0.25	2.90	2.02	1.22	3.00	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	3.00	0.25	2.65	1.64	1.21	3.00	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	8.50	0.75	7.90	7.19	6.64	9.00	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.00	0.75	6.40	6.14	6.32	8.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.50	1.00	11.65	11.21	11.81	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	18.00	1.50	16.65	15.91	16.82	21.50	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.25	5.25	5.08	5.49	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.00	0.75	10.25	9.78	10.50	14.25	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.50	0.50	5.00	4.70	5.01	6.75	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.75	0.75	7.15	7.71	7.72	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	18.25	0.75	17.70	17.34	17.74	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	10.50	0.00	10.55	9.63	10.02	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.05	3.96	3.54	5.75	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.00	4.55	4.44	3.52	9.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.25	0.00	4.30	3.66	0.77	12.00	-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	1.4460	-0.70	1Y	3.65	1.20	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5350	0.00	1.5Y	-0.50	1.00	-0.20	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.5810	-2.50	2Y	-1.35	3.75	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6850	1.50	3Y	-4.75	0.50	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.8200	2.80	4Y	-12.75	-0.55	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8970	3.50	5Y	-14.95	-0.75	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.1180	4.00	7Y	-29.30	-0.50	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.2370	4.50	10Y	-30.70	-1.00	-12.95	-37.25	6.00	-37.25

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1130.50	(-7.40)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-57.75	0.50	0.9050	1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	10.00	0.50
1.5Y	-58.50	0.00	0.9450	1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	10.00	0.00
2Y	-56.25	0.25	1.0050	1.50	1.2600	0.7950	2*5Y	19.50	1.00
3Y	-53.25	-0.50	1.1050	1.50	1.3550	0.7350	3*4Y	6.50	0.50
4Y	-52.25	-0.25	1.1700	2.00	1.4050	0.6900	3*5Y	9.50	1.00
5Y	-54.75	-0.25	1.2000	2.50	1.4500	0.6600	4*5Y	3.00	0.50
7Y	-58.00	-1.00	1.2450	2.50	1.4900	0.6550	5*7Y	4.50	0.00
10Y	-55.50	-1.00	1.3750	2.50	1.9050	0.6300	5*10Y	17.50	0.00

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M	42 / 42.25	ODD Tenor	
09M			
01Y	48.25 / 48.75		
1.5Y			
02Y	57 / 57.25	SPRD	1*2Y 8.5
03Y	63.5 / 63.75 / 64		1*3Y 15.5
04Y	69.75		3*5Y 11
05Y	73.75 / 75		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	54건 (+1건)	KTB	109.38	-0.06	109.42	109.43	109.34
금 액	10,460억원 (+1,065억원)	LKTB	124.5	-0.46	124.82	124.89	124.29

장중동향

전일 미 국채가격은 부진한 경제지표보다 스티븐 무느신 미 재무장관의 초장기물 발언 등 공급 관련 소식에 반응하면서 하락 마감. 국내 시장은 징검다리 연휴를 맞아 상당수 시장참가자가 자리를 비운 가운데 거래는 제한적. 국채선물은 장이 얇은 가운데 위험자산 선호와 미국의 초장기채 공급 증가 우려로 외인의 10선 매도가 두드러진 영향으로 하락 지속.

IRS, 휴일을 앞두고 휴가자가 많아 거래량 미미.
오전 신한은행 CD 발행이 예정된 가운데 6m 오퍼가 42.5에서 시작해 42(-0.25bp)까지 내려와 테이큰되며 거래 시작.
6m은 순간적으로 오퍼에 비해 비드가 월등히 많은 탓에 지속적으로 많은 거래가 이어지진 않았으나 42.25(0.00bp)까지 거래. 신한 CD 3개월물은 1.40%(언더 1)에 2,000억원이 발행되었으나 오전, 오후 모두 변동없이 1.41%(0.00bp) 마감.
1~3y 구간 위주로 호가 대치되었으며 주로 테이큰되는 분위기. 휴일을 앞둔 만큼 전반적 거래량은 많지 않았으나 다른 테너에 비해 2y이 57(+1.5bp)~57.25(+1.75bp)까지 거래되며 활발한 모습.
단기구간은 오퍼리시, 장기구간은 비디쉬한 장세에 커브는 스티프닝.

CRS, 거래가 거의 없을 정도로 조용한 분위기. 커브 스티프닝.

ETC

***호주RBA 기준금리 결정[13:30] ★1.50%로 9개월째 동결**

2017.5.2(화) 통화안정증권 중도환매 경쟁입찰 실시 결과

□ 매입예정금액 : 20,000억원, 응찰액 : 36,700억원, 낙찰액 : 20,000억원
- ㅇ 통안증권(2년물)0170-1708-0204 응찰 9,500억원 낙찰 6,400억원 1.28~1.30%; 부분낙찰률 : 0~50%
- ㅇ 통안증권(2년물)0156-1710-0204 응찰 9,700억원 낙찰 5,500억원 1.33~1.34%; 부분낙찰률 : 70~80%
- ㅇ 통안증권(2년물)0173-1712-0204 응찰 7,300억원 낙찰 4,200억원 1.35~1.37%; 부분낙찰률 : 57~100%
- ㅇ 통안증권(2년물)0149-1802-0204 응찰 10,200억원 낙찰 3,900억원 1.39~1.40%; 부분낙찰률 : 50~80%

□ 증권인도 및 대금결제일 : 2017.5.8(월)