

IPS Daily Closing Brief

2017-05-08

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	0.25	1.4220	1.4305	1.4703	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875	
9M	1.4500	0.50	1.4500	1.4521	1.4833	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500	
1Y	1.4825	1.00	1.4785	1.4705	1.4964	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200	
1.5Y	1.5275	1.00	1.5235	1.5100	1.5310	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5675	1.50	1.5595	1.5443	1.5641	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6400	1.75	1.6270	1.6064	1.6276	1.7850	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6950	2.00	1.6805	1.6571	1.6824	1.8450	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.7475	2.00	1.7325	1.7046	1.7324	1.9050	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.8275	2.50	1.8075	1.7808	1.8093	1.9925	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.9325	2.75	1.9125	1.8783	1.9092	2.1025	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.9725	2.75	1.9525	1.9188	1.9450	2.1575	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9750	2.75	1.9565	1.9236	1.9453	2.1850	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.9725	2.50	1.9545	1.9164	1.9204	2.2175	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	2.75	0.25	2.80	2.16	1.30	3.00	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	3.25	0.50	2.85	1.84	1.31	3.25	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	8.50	0.50	8.10	7.38	6.77	9.00	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	7.25	0.25	6.75	6.21	6.35	8.00	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	12.75	0.50	12.10	11.29	11.83	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	18.00	0.50	17.30	16.04	16.83	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.50	0.25	5.35	5.08	5.48	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	10.75	0.25	10.55	9.83	10.48	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	5.25	0.00	5.20	4.75	5.00	6.50	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	8.00	0.50	7.50	7.61	7.69	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	18.50	0.75	18.00	17.36	17.68	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	10.50	0.25	10.50	9.75	9.99	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.05	3.58	5.75	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.25	0.00	4.40	4.54	3.60	9.00	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	4.00	-0.25	4.20	3.81	1.12	12.00	-11.00	31.00	-11.00	
BOND			BOND SWAP SPRD			(1-2Y 동안 3-10Y 국고금투현 시가평가 민평평균 기준)				
Tenor	Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
1Y	1.4450	0.30	1Y	3.75	0.70	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5400	1.00	1.5Y	-1.25	0.00	-0.20	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6270	1.70	2Y	-5.95	-0.20	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.7000	1.80	3Y	-6.00	-0.05	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.8300	2.30	4Y	-13.50	-0.30	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.9120	2.80	5Y	-16.45	-0.80	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.1220	2.40	7Y	-29.45	0.10	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.2370	2.50	10Y	-30.45	0.25	-12.95	-37.25	6.00	-37.25	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1131.40	(-1.30)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-54.75	0.50	0.9350	1.50	1.4000	0.7650	1*2Y	9.00	0.50	
1.5Y	-55.75	0.50	0.9700	1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	10.50	0.50	
2Y	-54.25	0.50	1.0250	2.00	1.2600	0.7950	2*5Y	19.50	0.50	
3Y	-51.00	0.75	1.1300	2.50	1.3550	0.7350	3*4Y	6.00	0.00	
4Y	-50.50	0.50	1.1900	2.50	1.4050	0.6900	3*5Y	9.00	0.00	
5Y	-52.75	0.50	1.2200	2.50	1.4500	0.6600	4*5Y	3.00	0.00	
7Y	-56.25	0.00	1.2650	2.50	1.4900	0.6550	5*7Y	4.50	0.00	
10Y	-53.75	-0.25	1.3950	2.50	1.9050	0.6300	5*10Y	17.50	0.00	

TODAY DEAL LEVEL							
IRS	Lv.	ODD Tenor					
06M							
09M							
01Y	47.75 / 48 / 48.25						
1.5Y							
02Y	56.25 / 56.5	SPRD	1*2Y 8.5				
03Y	63.5						
04Y							
05Y	75.25						
07Y							
10Y							
12Y							
15Y							
20Y							
CRS	1Y 93.5						
	2Y 2.5						
TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	60건 (+20건)	KTB	109.35	-0.06	109.38	109.38	109.33
금 액	17,428억원 (+6,818억원)	LKTB	124.54	-0.26	124.69	124.69	124.39

장중동향

국채선물, 프랑스 대선에서 중도파인 에마뉘엘 마크롱 후보의 승리로 위험회피 심리가 완화돼 하락 출발. 입찰 헤지성 매도와 중국 경제지표 호조 등이 복합적 영향으로 인한 리스크 온 분위기. 주가가 고공행진하면서 외인이 10선 순매도에 나서 채권 약세흐름 심화.

IRS, 코스피 상승에 따른 위험자산 선호에 외인이 10년 국채선물을 매도하면서 채권시장의 전반적인 약세 흐름과 연동. 단기기간 상승이 제한되면서 커브 스티프닝.

아직 대선 휴일이 남아 있어 휴가자가 많아 조용한 분위기 지속되며 장중 마켓 거래량은 그리 많지 않음.

1Y~3Y구간 단기물 위주로 호가 대치 및 거래.

1Y 47.75~48.25 (+0.5~1.0bp), 2Y 56.25~56.5(+1.0~1.25bp), 3Y 63.5 (+1.25bp), 1*2Y 8.5 (+0.5bp) 거래.

CRS, 1-2Y구간으로 호가 대치가 활발히 이루어졌고 2년 위주로 거래되면서 금리 상승. 그동안의 레벨 하락으로 대가하던 부채스왑 물량이 유입되는 분위기.

ETC

- * 국고 3년 입찰 0.6조 선매출 [09:40~10:00] ★1.73% 낙찰
- * 통안 182일물 0.6조 입찰 [10:00~10:10] ★1.34% 낙찰
- * 국고 3년 입찰 1.2조[10:40~11:00] ★1.705% 낙찰
- * 통안 91일물 1조[13:03~13:40] ★1.29% 낙찰