

IPS Daily Closing Brief

2017-05-10

IRS			91d CD			1.41	(0.00)	CALL	1.23	(+0.01)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.4325	1.00	1.4240	1.4294	1.4694	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875	
9M	1.4650	1.50	1.4525	1.4519	1.4830	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500	
1Y	1.4975	1.50	1.4825	1.4711	1.4967	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200	
1.5Y	1.5500	2.25	1.5290	1.5115	1.5319	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5950	2.75	1.5675	1.5460	1.5654	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6750	3.50	1.6385	1.6089	1.6293	1.7850	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.7325	3.75	1.6930	1.6596	1.6841	1.8450	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.7900	4.25	1.7465	1.7074	1.7342	1.9050	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.8750	4.75	1.8240	1.7836	1.8111	1.9925	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.9925	6.00	1.9310	1.8820	1.9111	2.1025	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	2.0275	5.50	1.9700	1.9223	1.9470	2.1575	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	2.0300	5.50	1.9735	1.9270	1.9475	2.1850	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	2.0275	5.50	1.9715	1.9200	1.9238	2.2175	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	3.25	0.50	2.85	2.25	1.36	3.25	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	3.25	0.00	3.00	1.93	1.37	3.25	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	9.75	1.25	8.50	7.49	6.88	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	8.00	0.75	7.10	6.29	6.39	8.00	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	13.75	1.00	12.55	11.36	11.87	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	19.50	1.50	17.90	16.14	16.88	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.75	0.25	5.45	5.08	5.48	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	11.50	0.75	10.80	9.85	10.49	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	5.75	0.50	5.35	4.78	5.01	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	8.50	0.50	7.75	7.63	7.69	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	20.25	1.75	18.45	17.46	17.69	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	11.75	1.25	10.70	9.84	10.00	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.50	-0.50	3.90	4.03	3.60	5.75	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	3.75	-0.50	4.25	4.50	3.64	9.00	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	3.50	-0.50	4.05	3.80	1.27	12.00	-11.00	31.00	-11.00	
BOND			BOND SWAP SPRD			(1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)				
Tenor	Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
1Y	1.4560	1.10	1Y	4.15	0.40	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5510	1.10	1.5Y	-0.10	1.15	-0.10	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6500	2.30	2Y	-5.50	0.45	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.7320	3.20	3Y	-5.70	0.30	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.8750	4.50	4Y	-14.25	-0.75	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.9570	4.50	5Y	-16.70	-0.25	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.1760	5.40	7Y	-30.10	-0.65	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.3000	6.30	10Y	-30.75	-0.30	-12.95	-37.25	6.00	-37.25	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1135.80	(+4.40)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-52.75	2.00	0.9700	3.50	1.4000	0.7650	1*2Y	10.00	1.00	
1.5Y	-54.00	1.75	1.0100	4.00	1.2850	0.8100	2*3Y	11.00	0.50	
2Y	-52.50	1.75	1.0700	4.50	1.2600	0.7950	2*5Y	22.00	2.50	
3Y	-49.50	1.50	1.1800	5.00	1.3550	0.7350	3*4Y	7.00	1.00	
4Y	-48.25	2.25	1.2500	6.00	1.4050	0.6900	3*5Y	11.00	2.00	
5Y	-50.00	2.75	1.2900	7.00	1.4500	0.6600	4*5Y	4.00	1.00	
7Y	-53.50	2.75	1.3400	7.50	1.4900	0.6550	5*7Y	5.00	0.50	
10Y	-52.25	1.50	1.4700	7.50	1.9050	0.6300	5*10Y	18.00	0.50	

TODAY DEAL LEVEL								
IRS	Lv.		ODD Tenor					
06M	43.25							
09M								
01Y	49							
1.5Y								
02Y	57.75 / 58 / 59.5		SPRD	1*2Y	8.75			
03Y	65.5			2*3Y	7.5			
04Y	70.75			2*5Y	18.5			
05Y				5*10Y	19.25 / 19.75			
07Y								
10Y	95.5 / 96							
12Y								
15Y	0.5 / 0.75							
20Y								
CRS	2Y 4.5 / 05							
	5Y 24							
TODAY KRX CCP			국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	122건 (+62건)		KTB	109.2	-0.15	109.28	109.32	109.2
금 액	36,555억원 (+19,127억원)		LKTB	123.88	-0.66	124.2	124.33	123.86

장중동향

금일 채권은 새 정부의 재정지출 확대에 대한 부담, 위험자산 선호등이 맞물려 약세유지. 6월에있을 FOMC 금리인상 기대로 한동안 약세분위기가 지속될것으로 예상. 국고채 30년물 입찰은 예상보다 부진하며 2.445%로 낙찰.

IRS는 외국인의 국채선물 매도에 큰폭으로 약세를 보이면서 비드가 유입되 레벨상승. 장 막판에 국채선물이 급락하면서 금리 상승폭이 확대되며 마감. 단기쪽 6개월,9개월은 초이스로 거래가 되었고, 장기쪽 12년,15년 포린오퍼가 많은 양상.

CRS도 부채스왑 대기물량으로 금리가 상승하며 커브 스틱마감.

ETC

* 국고 30y 1조 4500억 입찰 [10:40~11:00] ★2.445% 낙찰