

IPS Daily Closing Brief

2017-05-12

IRS			91d CD			1.40	(0.00)	CALL	1.23	(0.00)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.4100	-1.50	1.4220	1.4260	1.4669	1.6725	1.2875	2.8550	1.2875	
9M	1.4425	-1.50	1.4520	1.4503	1.4816	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500	
1Y	1.4725	-1.50	1.4825	1.4710	1.4963	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200	
1.5Y	1.5200	-2.00	1.5310	1.5125	1.5325	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5650	-2.00	1.5730	1.5480	1.5668	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6450	-2.25	1.6500	1.6126	1.6313	1.7850	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.7050	-2.25	1.7070	1.6638	1.6862	1.8450	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.7600	-2.50	1.7620	1.7118	1.7365	1.9050	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.8400	-3.00	1.8430	1.7875	1.8135	1.9925	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.9550	-3.00	1.9540	1.8875	1.9137	2.1025	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.9925	-2.75	1.9915	1.9274	1.9498	2.1575	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9950	-2.75	1.9940	1.9319	1.9505	2.1850	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.9925	-2.75	1.9920	1.9256	1.9288	2.2175	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	3.25	0.00	3.00	2.42	1.47	3.25	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	3.00	0.00	3.05	2.08	1.47	3.25	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	9.25	-0.50	9.05	7.70	7.05	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	8.00	-0.25	7.70	6.46	6.45	8.25	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	14.00	-0.25	13.40	11.58	11.94	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	19.50	-0.50	18.90	16.38	16.97	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	6.00	0.00	5.70	5.11	5.49	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	11.50	-0.25	11.20	9.91	10.52	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	5.50	-0.25	5.50	4.80	5.03	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	8.00	-0.50	8.10	7.58	7.70	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	19.50	-0.50	19.20	17.58	17.72	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	11.50	0.00	11.10	10.00	10.01	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.75	0.25	3.75	3.99	3.61	5.50	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.00	0.25	4.00	4.44	3.68	8.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	3.75	0.25	3.80	3.81	1.51	11.75	-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	1.4440	-0.80	1Y	2.85	-0.70	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5320	-1.00	1.5Y	-1.20	-1.00	-0.10	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6120	-1.60	2Y	-4.70	-0.40	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.7070	-1.80	3Y	-6.20	-0.45	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.8520	-1.50	4Y	-14.70	-0.75	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.9390	-1.30	5Y	-17.90	-1.20	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.1620	-1.50	7Y	-32.20	-1.50	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.2920	-1.50	10Y	-33.70	-1.50	-12.95	-37.25	6.00	-37.25	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1127.40	(-0.50)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-54.25	1.00	0.9300	-0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	12.50	0.00	
1.5Y	-54.50	1.00	0.9750	-1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	11.50	0.00	
2Y	-51.00	1.50	1.0550	-0.50	1.2600	0.7950	2*5Y	22.50	-0.50	
3Y	-47.50	1.75	1.1700	-0.50	1.3550	0.7350	3*4Y	7.50	0.00	
4Y	-46.00	1.75	1.2450	-0.50	1.4050	0.6900	3*5Y	11.00	-0.50	
5Y	-48.00	1.50	1.2800	-1.00	1.4500	0.6600	4*5Y	3.50	-0.50	
7Y	-51.00	2.00	1.3300	-1.00	1.4900	0.6550	5*7Y	5.00	0.00	
10Y	-49.50	2.00	1.4600	-1.00	1.9050	0.6300	5*10Y	18.00	0.00	

TODAY DEAL LEVEL								
IRS	Lv.		ODD Tenor					
06M	42							
09M								
01Y	47.25 / 48.5 / 48.75							
1.5Y								
02Y			SPRD	1.5*2y	4.5			
03Y				5*6y	4.25			
04Y	70.5 / 70.75 / 71.75			3*10y	31.75			
05Y				15*20y	00			
07Y								
10Y								
12Y								
15Y								
20Y	99.5							
CRS	2*4y 18.5							
TODAY KRX CCP			국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황			KTB	109.33	0.07	109.29	109.34	109.26
금 액			LKTB	124.04	0.24	123.95	124.1	123.77

장중동향

채권은 외국인의 동향에따라 움직이는 장세가 이어짐. 채권선물은 강보합으로 시작해 등락하다가 증권이 매수세를 보인 3년선물은 7틱상승한 109.33으로, 외국인이 매수세를 보인 10년 선물은 24틱 상승한 124.04로 마감.

IRS는 전체적으로 아웃라잇 오퍼가 강한 모습. 단기쪽은 ND오퍼가 두드러지며 1년은 48.75가 기본될때 48.5 ND오퍼가 테이크되기도 함. 5년까지는 오퍼가 우세했고, 4*10년 5*10년 등으로 스프레드오퍼가나오면서 장기쪽도 오퍼리쉬. 20년 아웃라잇과 20년 관련 스프레드거래도 이어졌는데 포린오퍼와 증권,로컬 비드의 구도. 외인의 10년 순매수로 이자율금리도 장기쪽으로 강세를 보이며 커브 플랫 마감.

CRS는 대체적으로 조용한 가운데 전체적으로 레벨 하락 마감.

ETC