

IPS Daily Closing Brief

2017-05-17

IRS			91d CD			1.39	(-0.01)	CALL	1.23	(0.00)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.4050	-0.75	1.4125	1.4226	1.4626	1.6725	1.2875	2.8550	1.2875	
9M	1.4275	-1.25	1.4415	1.4483	1.4786	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500	
1Y	1.4525	-1.25	1.4690	1.4711	1.4943	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200	
1.5Y	1.4950	-1.75	1.5165	1.5139	1.5317	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5275	-2.75	1.5585	1.5505	1.5667	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6050	-3.50	1.6405	1.6186	1.6324	1.7850	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6575	-4.75	1.7010	1.6710	1.6877	1.8450	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.7125	-4.75	1.7565	1.7196	1.7383	1.9050	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7875	-5.00	1.8355	1.7946	1.8158	1.9925	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8925	-5.50	1.9465	1.8968	1.9163	2.1025	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.9275	-5.50	1.9825	1.9360	1.9526	2.1575	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9325	-5.25	1.9855	1.9403	1.9535	2.1850	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.9350	-5.25	1.9850	1.9358	1.9339	2.2175	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	2.25	-0.50	2.90	2.56	1.60	3.25	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	2.50	0.00	2.75	2.29	1.58	3.25	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	7.50	-1.50	8.95	7.94	7.24	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	7.75	-0.75	8.20	6.81	6.57	8.50	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	13.00	-2.00	14.25	12.05	12.10	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	18.50	-2.00	19.80	16.91	17.16	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.25	-1.25	6.05	5.24	5.53	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	10.75	-1.25	11.60	10.10	10.59	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	5.50	0.00	5.55	4.86	5.07	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	7.50	-0.25	7.90	7.50	7.74	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	18.00	-0.75	19.00	17.71	17.79	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	10.50	-0.50	11.10	10.21	10.05	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.50	0.00	3.60	3.93	3.64	5.50	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.00	0.25	3.90	4.35	3.73	8.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	4.25	0.25	3.85	3.90	1.76	11.50	-11.00	31.00	-11.00	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1118.30	(+2.30)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-55.25	-1.25	0.9000	-2.50	1.4000	0.7650	1*2Y	15.00	-1.00	
1.5Y	-52.50	-0.25	0.9700	-2.00	1.2850	0.8100	2*3Y	12.50	-1.00	
2Y	-47.75	-0.75	1.0500	-3.50	1.2600	0.7950	2*5Y	22.50	-2.50	
3Y	-43.00	-1.00	1.1750	-4.50	1.3550	0.7350	3*4Y	6.00	-1.00	
4Y	-42.25	-0.75	1.2350	-5.50	1.4050	0.6900	3*5Y	10.00	-1.50	
5Y	-43.75	-1.25	1.2750	-6.00	1.4500	0.6600	4*5Y	4.00	-0.50	
7Y	-47.75	-1.50	1.3100	-6.50	1.4900	0.6550	5*7Y	3.50	-0.50	
10Y	-44.75	-1.50	1.4450	-7.00	1.9050	0.6300	5*10Y	17.00	-1.00	

TODAY DEAL LEVEL										
IRS		Lv.		ODD Tenor						
06M										
09M										
01Y		45.5								
1.5Y		49.75 / 50								
02Y		52.75 / 53.75		SPRD	9*12M		2*5			
03Y					1*2Y		7.25			
04Y		66.25 / 67.75			1*3Y		16			
05Y		73			2*3Y		08			
07Y					3*5Y		11			
10Y		89.5 / 91.25			10*15Y		04			
12Y										
15Y					1*3*5Y		05			
20Y										
CRS	1Y		89							
	4Y		25							
TODAY KRX CCP				국채선물	Lv.	전일비	시	고	저	
거래현황				102건 (+7건)	KTB	109.44	0.13	109.38	109.46	109.37
금 액				31,773억원 (+10,271억원)	LKTB	124.55	0.64	124.29	124.55	124.21

장중동향

미국 국채금리, 경제지표 혼조 속에 트럼프 대통령의 정책 실행 불확실성이 채권 매수로 연결되면서 하락.
 아시아 시장에서도 안전자산 선호 현상이 나타나며 국내 채권도 강세로 출발. 러시아 기밀 유출 의혹과 FBI 국장 해임 등으로 트럼프 대통령의 탄핵론이 힘을 받으면서 안전자산 선호 분위가 더욱 강화. 외인도 3선 10선을 계속 사면서 막판 국채금리 선물 더욱 급등.

IRS, 안전자산 선호 분위기 강화로 채권금리를 추중하며 금리 하락. 커브 플랫닝.
 단기구간 위주, 특히 2Y이 호가 대치 및 거래 활발. 2년은 오퍼가 내내 줄서있어 테이큰 되는 분위기. 53.75(-1.75bp)에 다수 거래. 5Y은 73(-3.00bp)에 순간적 거래 활기.
 단기쪽에서 헤지펀드 오퍼가 유입되기도 함. 10Y 거래 일부 본드스왑 물량도 있었던 것으로 추정되며, 구조화물량 장기 스프레드 비드도 꾸준한 수요를 보임.

CRS, 전일 금리 반등에 대한 되돌림 분위기로 하락 마감. 커브 플랫닝.
 전일 수자원공사 달러채 발행에 따른 부채스왑 영향으로 인한 중기 테너 금리 반등. 금일은 당분간 큰 라이어빌리티가 없을 것이라 관측으로 옛 오퍼가 우위를 보이며 중장기 구간 위주로 레벨 하락.

ETC

* 91d CD [오전] 시중 1.40% (전일대비 0.00) / 특수 1.36% (전일대비 0.00)
 [오후] 시중 1.39% (전일대비 -0.01) / 특수 1.36% (전일대비 0.00)

* [10:00~10:10] 통안 2Y 2조 3000억 입찰 ★1.61% 낙찰