

IPS Daily Closing Brief

2017-05-23

IRS			91d CD			1.39	(0.00)	CALL	1.23	(0.00)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.3975	-0.50	1.4020	1.4180	1.4565	1.6600	1.2875	2.8025	1.2875	
9M	1.4200	-0.50	1.4245	1.4446	1.4737	1.6575	1.2500	2.7900	1.2500	
1Y	1.4450	-0.50	1.4495	1.4700	1.4907	1.6550	1.2200	2.8150	1.2200	
1.5Y	1.4850	-0.75	1.4905	1.5140	1.5290	1.6700	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5200	-1.00	1.5245	1.5511	1.5643	1.6975	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.5875	-1.25	1.5965	1.6214	1.6309	1.7725	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6400	-1.25	1.6500	1.6754	1.6859	1.8450	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.6875	-1.75	1.7020	1.7261	1.7366	1.9050	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7600	-2.00	1.7750	1.8004	1.8140	1.9925	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8625	-2.25	1.8790	1.9054	1.9144	2.1025	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.8975	-2.25	1.9145	1.9436	1.9512	2.1575	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9050	-2.25	1.9215	1.9484	1.9526	2.1850	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.9100	-2.25	1.9260	1.9474	1.9358	2.2175	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	2.25	0.00	2.25	2.66	1.72	3.25	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	2.50	0.00	2.50	2.54	1.70	3.25	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	7.50	-0.50	7.50	8.11	7.37	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	6.75	-0.25	7.20	7.03	6.65	8.50	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	12.00	-0.25	12.55	12.43	12.16	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	16.75	-0.75	17.75	17.50	17.23	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.25	0.00	5.35	5.40	5.50	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	10.00	-0.50	10.55	10.48	10.57	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	4.75	-0.50	5.20	5.08	5.07	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	7.25	-0.25	7.30	7.43	7.74	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	17.50	-0.50	17.70	17.93	17.78	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	10.25	-0.25	10.40	10.50	10.05	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.50	0.00	3.55	3.83	3.68	5.50	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.25	0.00	4.25	4.30	3.82	8.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	4.75	0.00	4.70	4.20	2.13	11.50	-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	0.00	1Y	0.00	-0.50	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5340	0.00	1.5Y	-4.90	-0.75	-0.10	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6070	-0.50	2Y	-8.70	-0.50	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6750	-1.00	3Y	-8.75	-0.25	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.8060	-1.40	4Y	-16.60	0.15	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8900	-1.50	5Y	-20.25	-0.25	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.1090	-2.10	7Y	-34.90	0.10	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.2470	-2.50	10Y	-38.45	0.25	-12.95	-38.70	6.00	-38.70	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1124.20	(+5.60)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-59.50	-3.00	0.8500	-3.50	1.4000	0.7650	1*2Y	12.50	0.00	
1.5Y	-57.00	-2.75	0.9150	-3.50	1.2850	0.8100	2*3Y	11.50	0.00	
2Y	-54.50	-2.50	0.9750	-3.50	1.2350	0.7950	2*5Y	19.00	-1.00	
3Y	-49.75	-2.25	1.0900	-3.50	1.3300	0.7350	3*4Y	5.50	-0.50	
4Y	-49.50	-2.75	1.1450	-4.00	1.3800	0.6900	3*5Y	7.50	-1.00	
5Y	-52.25	-2.75	1.1650	-4.50	1.4350	0.6600	4*5Y	2.00	-0.50	
7Y	-56.00	-2.50	1.2000	-4.50	1.4700	0.6550	5*7Y	3.50	0.00	
10Y	-52.25	-2.25	1.3400	-4.50	1.9050	0.6300	5*10Y	17.50	0.00	

TODAY DEAL LEVEL								
IRS	Lv.		ODD Tenor	11Y 90				
06M								
09M	42.5							
01Y								
1.5Y	48.5 / 48.75							
02Y	52.25 / 52.5 / 52.75		SPRD	1.5*2Y 3.75				
03Y	58.75 / 59.5 / 60			2*5Y 16.5				
04Y	65			3*5Y 10.25				
05Y	70 / 70.25 / 70.5							
07Y								
10Y	88 / 88.25							
12Y								
15Y								
20Y								
CRS								
TODAY KRX CCP			국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황 66건 (-28건)			KTB	109.5	0.06	109.48	109.5	109.42
금 액 17,495억원 (-6,653원)			LKTB	124.6	0.32	124.45	124.60	124.26

장중동향

국채선물, 영국 맨체스터 경기장에서 폭발이 발생하면서 다수의 사상자가 나왔다는 소식에 글로벌 안전자산 선호 분위기가 조성 및 신정부 재정정책으로 심리 위축 분위기. 장중 되밀리기도 하며 오락가락 했으나 장 막판 외인 매수에 따라 강하게 마감.

IRS, 외인이 3년, 10년 국채선물을 순매수하면서 금리가 하락.
 장중 상대적으로 비드가 우위를 보이면서 벌어진 본드스왑 역전폭이 조금 해소되기도 했으나 장 막판 국채선물이 오름 폭을 키우면서 IRS 금리가 더 하락.
 전반적으로 2Y,3Y,5Y,10Y 위주의 거래. 특히 2Y,3Y이 활발 거래. 2Y 52.25(-0.75bp)~52.75(-0.25bp), 3Y 58.75(-1.25bp)~60(0.00bp) 거래.

CRS, 에셋스왑 영향에 전 구간에서 하락 마감. 달러 자금이 부족해 FX스왑 단기물 쪽이 하락한 영향도 있어 보임.

ETC

- * KEB하나은행 CD 91d (만기 2017-08-22) 1.38% 1,500억원 발행
- * CD 91d [오전] 시중 1.39% (전일비 0.00) / 특수 1.36% (전일비 0.00)
 [오후] 시중 1.38% (전일비 -0.01) / 특수 1.36% (전일비 0.00)