

IPS Daily Closing Brief

2017-05-24

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	1.4025	0.50	1.4015	1.4169	1.4549	1.6600	1.2875	2.8025	1.2875	
9M	1.4250	0.50	1.4240	1.4438	1.4724	1.6525	1.2500	2.7900	1.2500	
1Y	1.4525	0.75	1.4495	1.4699	1.4897	1.6500	1.2200	2.8150	1.2200	
1.5Y	1.4975	1.25	1.4910	1.5144	1.5282	1.6700	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5325	1.25	1.5255	1.5518	1.5635	1.6975	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6025	1.50	1.5960	1.6230	1.6302	1.7725	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6550	1.50	1.6495	1.6775	1.6851	1.8450	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.7050	1.75	1.7005	1.7289	1.7356	1.9050	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7750	1.50	1.7725	1.8033	1.8128	1.9925	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8825	2.00	1.8770	1.9095	1.9132	2.1025	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.9175	2.00	1.9125	1.9474	1.9500	2.1575	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9250	2.00	1.9200	1.9523	1.9517	2.1850	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.9325	2.25	1.9255	1.9521	1.9355	2.2175	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	2.25	0.00	2.25	2.69	1.75	3.25	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	2.75	0.25	2.55	2.61	1.73	3.25	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	8.00	0.50	7.60	8.19	7.39	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	7.00	0.25	7.05	7.13	6.66	8.50	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	12.25	0.25	12.40	12.58	12.15	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	17.25	0.50	17.50	17.71	17.21	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.25	0.00	5.35	5.45	5.49	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	10.25	0.25	10.45	10.59	10.55	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	5.00	0.25	5.10	5.14	5.05	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	7.00	-0.25	7.20	7.44	7.72	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	17.75	0.25	17.65	18.06	17.76	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	10.75	0.50	10.45	10.63	10.04	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.50	0.00	3.55	3.79	3.68	5.50	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.25	0.00	4.30	4.28	3.85	8.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	5.00	0.25	4.85	4.26	2.23	11.50	-11.00	31.00	-11.00	
BOND			BOND SWAP SPRD			(1-2Y 동안 3-10Y 국고,금투현 시가평가 민평평균 기준)				
Tenor	Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
1Y	1.4510	0.60	1Y	0.15	0.15	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5410	0.70	1.5Y	-4.35	0.55	-0.10	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6170	1.00	2Y	-8.45	0.25	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6900	1.50	3Y	-8.75	0.00	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.8270	2.10	4Y	-17.20	-0.60	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.9120	2.20	5Y	-20.70	-0.45	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.1290	2.00	7Y	-35.40	-0.50	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.2650	1.80	10Y	-38.25	0.20	-12.95	-38.70	6.00	-38.70	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1126.80	(+2.60)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-58.75	0.75	0.8650	1.50	1.4000	0.7650	1*2Y	12.00	-0.50	
1.5Y	-56.75	0.25	0.9300	1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	11.50	0.00	
2Y	-54.75	-0.25	0.9850	1.00	1.2350	0.7950	2*5Y	20.50	1.50	
3Y	-50.25	-0.50	1.1000	1.00	1.3300	0.7350	3*4Y	6.00	0.50	
4Y	-49.50	0.00	1.1600	1.50	1.3800	0.6900	3*5Y	9.00	1.50	
5Y	-51.50	0.75	1.1900	2.50	1.4350	0.6600	4*5Y	3.00	1.00	
7Y	-55.00	1.00	1.2250	2.50	1.4700	0.6550	5*7Y	3.50	0.00	
10Y	-50.25	2.00	1.3800	4.00	1.9050	0.6300	5*10Y	19.00	1.50	

TODAY DEAL LEVEL										
IRS	Lv.				ODD Tenor	8y 82				
06M	40.25					11y 89.5				
09M										
01Y	45.25									
1.5Y	49.25									
02Y	53 / 53.25				SPRD	6*9m 2.25				
03Y						5*8y 11.5				
04Y						5*10y 17.25				
05Y	70 / 70.25 / 70.5					15*20y 0.75				
07Y										
10Y	87.25 / 87.75 / 88 / 88.5 / 88.75									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	1y 87.5									
TODAY KRX CCP					국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황		81건 (+15건)			KTB	109.43	-0.07	109.45	109.48	109.42
금 액		20,441억원 (+2,946원)			LKTB	124.40	-0.20	124.33	124.51	124.27

장중동향

최근 주식시장이 최고치를 경신하면서 위험자산 감세분위기, FOMC 회의록공개와 금통위를 앞두고 금리인상 가능성에 따른 리스크관리로 채권은 약세.

IRS는 채권약세 대비 상대적으로 강한 모습을 보이면서 본드스왑은 더욱 확대되었고, 장기물 약세로 커브는 스틱 마감. 증권사들의 본드스왑 비드와 포린오퍼가 눈에 띄었고, 5년,10년 거래가 활발, 15*20년등 장기스플 거래도 꾸준.

CRS는 부채 기대감이 작용한듯 보이며 레벨상승하며 커브 스틱마감.

ETC