

IPS Daily Closing Brief

2017-05-29

IRS			91d CD			1.38	(0.00)	CALL	1.22	(0.00)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.3975	0.00	1.3990	1.4118	1.4502	1.6550	1.2875	2.8000	1.2875	
9M	1.4225	0.25	1.4220	1.4383	1.4687	1.6375	1.2500	2.7900	1.2500	
1Y	1.4500	0.25	1.4490	1.4656	1.4869	1.6325	1.2200	2.8150	1.2200	
1.5Y	1.4950	0.50	1.4915	1.5105	1.5261	1.6475	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5375	1.00	1.5290	1.5484	1.5619	1.6650	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6100	1.50	1.5975	1.6208	1.6290	1.7250	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6650	1.75	1.6500	1.6760	1.6838	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.7175	2.00	1.7000	1.7285	1.7343	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7925	2.50	1.7710	1.8035	1.8113	1.9300	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8950	2.75	1.8740	1.9101	1.9116	2.0375	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.9325	2.75	1.9105	1.9474	1.9487	2.0925	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9425	2.75	1.9195	1.9529	1.9511	2.1200	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.9475	2.75	1.9255	1.9543	1.9370	2.1500	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	2.50	0.25	2.30	2.65	1.85	3.25	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	2.75	0.00	2.70	2.74	1.82	3.25	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	8.75	0.75	8.00	8.28	7.50	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	7.25	0.50	6.85	7.24	6.71	8.50	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	12.75	0.75	12.10	12.76	12.19	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	18.00	1.00	17.10	18.01	17.23	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.50	0.25	5.25	5.53	5.48	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	10.75	0.50	10.25	10.78	10.53	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	5.25	0.25	5.00	5.25	5.05	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	7.50	0.50	7.10	7.50	7.70	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	17.75	0.75	17.40	18.16	17.73	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	10.25	0.25	10.30	10.66	10.03	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.75	0.00	3.65	3.73	3.71	5.50	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.75	0.00	4.55	4.28	3.95	8.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	5.25	0.00	5.15	4.41	2.54	11.25	-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	1.4520	0.00	1Y	-0.20	0.25	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5340	-0.30	1.5Y	-3.90	0.80	-0.10	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6020	-0.80	2Y	-6.45	1.80	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6700	-0.40	3Y	-6.00	1.90	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.8070	-0.20	4Y	-14.20	1.95	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8870	-0.30	5Y	-16.95	2.30	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.1090	0.60	7Y	-31.65	1.90	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.2450	1.00	10Y	-35.00	1.75	-12.95	-38.70	6.00	-38.70	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1121.70	(+1.00)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-57.50	1.25	0.8750	1.50	1.4000	0.7650	1*2Y	12.50	0.50	
1.5Y	-55.50	1.00	0.9400	1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	11.00	0.00	
2Y	-53.75	1.00	1.0000	2.00	1.2250	0.7950	2*5Y	20.00	0.00	
3Y	-50.00	0.50	1.1100	2.00	1.3250	0.7350	3*4Y	5.50	0.00	
4Y	-50.00	0.25	1.1650	2.00	1.3750	0.6900	3*5Y	9.00	0.00	
5Y	-51.75	0.00	1.2000	2.00	1.4350	0.6600	4*5Y	3.50	0.00	
7Y	-56.25	-0.50	1.2300	2.00	1.4600	0.6550	5*7Y	3.00	0.00	
10Y	-51.00	-0.75	1.3850	2.00	1.9050	0.6300	5*10Y	18.50	0.00	

TODAY DEAL LEVEL									
IRS	Lv.				ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	53.25 / 53.75				SPRD				
03Y	59.75 / 60 / 60.5 / 60.75								
04Y	66.25								
05Y	71.25 / 71.75								
07Y									
10Y	89								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	5Y 19								
TODAY KRX CCP				국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황		51건 (-12건)		KTB	109.51	0.02	109.47	109.51	109.45
금 액		10,720억원 (-4,425원)		LKTB	124.66	-0.07	124.65	124.68	124.49

장중동향

IRS, 커브 스티프닝. 비디쉬한 모습을 보이며 채권 현물 대비 약세.
미국 메모리얼 데이 휴장 및 주요 시장이 휴장을 맞아 전반적으로 거래가 많지 않고 한산한 날.
수급 자체는 비드가 우위를 보이며 IRS 금리가 채권에 비해 좀 더 오르는 모습.
장중 내내 비디쉬한 분위기와 함께 본드스왑 역전폭이 중장기 구간 위주로 축소.
오전에는 국고채 20년물 입찰을 대기하면서 관망세가 짙었으나, 결과는 실수로 부진으로 시장 예상보다 약하게 낙찰.
전체적으로 5Y과 10Y 거래가 다수 있었으며, 5Y이 59.75(-10.00)~69.75(0.00)구간에서 거래. 10Y이 89(-2.25)에 여러번 거래.
본드스왑 이익 실현 물량 오퍼와 신규 진입 비드 모두 출현.

CRS, 전반적으로 조용한 가운데 FX스왑 상승을 반영해 다소 상승하며 마감.

ETC

* 국민은행 CD 91일물 (만기 2017-08-28) 1.38% 1,500억원 발행

* [10:00~10:10] 동안 1y 8000억 입찰 ★1.47% 낙찰

* [10:40~11:00] 국고 20y 8000억 입찰 ★2.385% 낙찰

* [13:30~13:40] 동안 91d 8000억 입찰 ★1.26% 낙찰