IPS Daily Closing Brief

2017-05-30

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	1.3925	-0.50	1.3980	1.4100	1.4485	1.6550	1.2875	2.7950	1.2875
9M	1.4175	-0.50	1.4215	1.4363	1.4674	1.6375	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4450	-0.50	1.4490	1.4638	1.4859	1.6325	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.4900	-0.50	1.4925	1.5085	1.5253	1.6450	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5300	-0.75	1.5310	1.5468	1.5613	1.6600	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6025	-0.75	1.6005	1.6196	1.6287	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6550	-1.00	1.6530	1.6749	1.6835	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7050	-1.25	1.7035	1.7275	1.7340	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7775	-1.50	1.7745	1.8025	1.8110	1.9300	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8800	-1.50	1.8775	1.9089	1.9113	2.0375	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9175	-1.50	1.9145	1.9460	1.9485	2.0925	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9275	-1.50	1.9240	1.9518	1.9511	2.1200	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9325	-1.50	1.9300	1.9535	1.9377	2.1500	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	2.50	0.00	2.35	2.63	1.89	3.25	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	2.75	0.00	2.75	2.75	1.85	3.25	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	8.50	-0.25	8.20	8.30	7.54	9.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.25	0.00	6.95	7.29	6.74	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.50	-0.25	12.20	12.81	12.22	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.50	-0.50	17.25	18.08	17.27	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	-0.25	5.25	5.53	5.48	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	-0.50	10.30	10.79	10.53	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.00	-0.25	5.05	5.26	5.05	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.25	-0.25	7.10	7.50	7.70	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	17.50	-0.25	17.40	18.14	17.73	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	10.25	0.00	10.30	10.64	10.03	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.70	3.71	3.72	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.65	4.29	3.98	8.25	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.00	5.25	4.46	2.64	11.25	-11.00	31.00	-11.00

BOND			BOND SWAP SPRD (1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)						
Tenor	Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.4450	-0.70	1Y	0.00	0.20	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5270	-0.70	1.5Y	-3.70	0.20	-0.10	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.5970	-0.50	2Y	-6.70	-0.25	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6570	-1.30	3Y	-5.45	0.55	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.7920	-1.50	4Y	-13.70	0.50	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8700	-1.70	5Y	-16.50	0.45	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0890	-2.00	7Y	-31.15	0.50	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.2250	-2.00	10Y	-34.50	0.50	-12.95	-38.70	6.00	-38.70

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1125.10	(+3.40)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-57.50	0.00	0.8700	-0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	12.00	-0.50
1.5Y	-56.00	-0.50	0.9300	-1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	11.00	0.00
2Y	-54.00	-0.25	0.9900	-1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	19.00	-1.00
3Y	-50.25	-0.25	1.1000	-1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	6.00	0.50
4Y	-49.50	0.50	1.1600	-0.50	1.3750	0.6900	3*5Y	8.00	-1.00
5Y	-52.50	-0.75	1.1800	-2.00	1.4350	0.6600	4*5Y	2.00	-1.50
7Y	-57.25	-1.00	1.2050	-2.50	1.4500	0.6550	5*7Y	2.50	-0.50
10Y	-53.00	-2.00	1.3500	-3.50	1.9050	0.6300	5*10Y	17.00	-1.50

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	6y 75.5
09M			
01Y	44.75		
1.5Y	49		
02Y	53	SPRD	
03Y	60.25 / 60.75		
04Y			
05Y	70 / 71		
07Y			
10Y	88		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	75건 (+24건)	KTB	109.57	0.06	109.52	109.60	109.51
금 액	17,480억원 (+6,760원)	LKTB	124.89	0.23	124.74	124.96	124.66

장중동향

금일 채권은 강보합으로 시작해서 외국인의 대규모 매수세에 상승하며 강세 마감.

IRS는 전체적으로 조용한 분위기 속에 장기물의 강세폭이 더 커지면서 장기구간을 중심으로 레벨이 하락하며 커브 플래트닝 마감. 거래는 2년~5년쪽으로 몰리는듯했고, 비드가 우세한 분위기로 오퍼가 나오면 거래가 성사됨. 채권 금리가 강해지면서 그간 격차가 많이 벌어졌전 본드스왑은 축소 마감.

CRS는 에셋영향으로 하락하면서 커브 플래트닝 마감.

ETC