IPS Daily Closing Brief

2017-05-31

IRS				91d CD	1.38	(0.00)	CALL	1.23	(+0.01)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3975	0.50	1.3970	1.4088	1.4467	1.6550	1.2875	2.7950	1.2875
9M	1.4225	0.50	1.4210	1.4348	1.4658	1.6375	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4500	0.50	1.4485	1.4624	1.4846	1.6325	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.4950	0.50	1.4920	1.5071	1.5242	1.6450	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5350	0.50	1.5315	1.5458	1.5602	1.6600	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6075	0.50	1.6015	1.6191	1.6278	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6625	0.75	1.6545	1.6745	1.6827	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7100	0.50	1.7045	1.7270	1.7330	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7825	0.50	1.7760	1.8020	1.8099	1.9300	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8850	0.50	1.8780	1.9081	1.9103	2.0375	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9225	0.50	1.9155	1.9451	1.9475	2.0925	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9325	0.50	1.9255	1.9511	1.9504	2.1200	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9375	0.50	1.9310	1.9533	1.9376	2.1500	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	2.50	0.00	2.40	2.60	1.91	3.25	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	2.75	0.00	2.75	2.76	1.88	3.25	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	8.50	0.00	8.30	8.34	7.56	9.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	7.25	0.00	7.00	7.34	6.76	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.75	0.25	12.30	12.88	12.25	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.50	0.00	17.30	18.13	17.28	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.50	0.25	5.30	5.54	5.48	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	10.25	0.00	10.30	10.79	10.52	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	-0.25	5.00	5.25	5.04	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.25	0.00	7.15	7.50	7.69	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	17.50	0.00	17.35	18.11	17.73	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	10.25	0.00	10.20	10.61	10.04	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.70	3.72	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.75	4.30	4.01	8.25	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.00	5.30	4.51	2.73	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	0.00	1Y	0.50	0.50	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5270	0.00	1.5Y	-3.20	0.50	-0.10	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.6050	0.80	2Y	-7.00	-0.30	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6670	1.00	3Y	-5.95	-0.50	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.8100	1.80	4Y	-14.75	-1.05	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8900	2.00	5Y	-18.00	-1.50	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.1010	1.20	7Y	-31.85	-0.70	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.2370	1.20	10Y	-35.20	-0.70	-12.95	-38.70	6.00	-38.70

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1119.50	(-5.60)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-60.00	-2.50	0.8500	-2.00	1.4000	0.7650	1*2Y	12.50	0.50
1.5Y	-58.50	-2.50	0.9100	-2.00	1.2850	0.8100	2*3Y	10.00	-1.00
2Y	-56.00	-2.00	0.9750	-1.50	1.2250	0.7950	2*5Y	17.50	-1.50
3Y	-53.25	-3.00	1.0750	-2.50	1.3150	0.7350	3*4Y	5.50	-0.50
4Y	-53.25	-3.75	1.1300	-3.00	1.3750	0.6900	3*5Y	7.50	-0.50
5Y	-56.00	-3.50	1.1500	-3.00	1.4350	0.6600	4*5Y	2.00	0.00
7Y	-60.25	-3.00	1.1800	-2.50	1.4500	0.6550	5*7Y	3.00	0.50
10Y	-56.50	-3.50	1.3200	-3.00	1.9050	0.6300	5*10Y	17.00	0.00

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	48.75		
02Y	53.5	SPRD	3*4Y 05
03Y	60.25		4*5Y 05
04Y	64.75 / 65.25		
05Y	70 / 70.25		
07Y	77		
10Y	87.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	71건 (-4건)	KTB	109.53	-0.04	109.59	109.61	109.53
금 액	18,470억원 (+990억원)	LKTB	124.81	-0.08	125.00	125.07	124.81

장중동향

IRS, 현물 금리에 연동되면서 장 막판 상승 전환되며 마감.
대부분 구간에서 0.5bp 상승. 장중 비디쉬한 분위기 이어져.
오전은 조용한 가운데 4-5Y 구간 거래가 있는 편이었고, 오후에도 2Y이 초이스, 리버스로 대치되는 양상을 보이며 여러 번 거래.

CRS, 거래가 거의 없는 분위기. FX 스왑 하락 영향을 받아 전구간 1.5-3.0bp 하락.

ETC