

IPS Daily Closing Brief

2017-06-01

IRS			91d CD			1.38	(0.00)	CALL	1.22	(-0.01)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.3925	-0.50	1.3955	1.4073	1.4449	1.6550	1.2875	2.7950	1.2875	
9M	1.4125	-1.00	1.4190	1.4329	1.4642	1.6350	1.2500	2.7900	1.2500	
1Y	1.4400	-1.00	1.4465	1.4605	1.4833	1.6325	1.2200	2.8150	1.2200	
1.5Y	1.4800	-1.50	1.4900	1.5051	1.5229	1.6450	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5175	-1.75	1.5295	1.5439	1.5589	1.6600	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.5850	-2.25	1.6000	1.6175	1.6267	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6400	-2.25	1.6540	1.6730	1.6815	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.6875	-2.25	1.7035	1.7254	1.7318	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7625	-2.00	1.7765	1.8006	1.8085	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8625	-2.25	1.8780	1.9065	1.9089	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.9000	-2.25	1.9155	1.9434	1.9462	2.0800	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9100	-2.25	1.9255	1.9496	1.9493	2.1075	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.9150	-2.25	1.9305	1.9521	1.9371	2.1375	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	2.00	-0.50	2.35	2.56	1.93	3.25	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	2.75	0.00	2.75	2.76	1.91	3.25	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	7.75	-0.75	8.30	8.34	7.57	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	6.75	-0.50	7.05	7.36	6.78	8.50	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	12.25	-0.50	12.45	12.91	12.26	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	17.00	-0.50	17.40	18.15	17.28	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.50	0.00	5.40	5.55	5.48	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	10.25	0.00	10.35	10.79	10.50	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	4.75	0.00	4.95	5.24	5.03	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	7.50	0.25	7.30	7.53	7.68	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	17.50	0.00	17.45	18.11	17.72	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	10.00	-0.25	10.15	10.59	10.04	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.69	3.73	5.50	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.75	0.00	4.75	4.31	4.04	8.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	5.25	0.00	5.25	4.56	2.82	11.25	-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	1.4310	-1.40	1Y	0.90	0.40	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5180	-0.90	1.5Y	-3.80	-0.60	-0.10	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.5870	-1.80	2Y	-6.95	0.05	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6400	-2.70	3Y	-5.50	0.45	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.7800	-3.00	4Y	-14.00	0.75	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8570	-3.30	5Y	-16.95	1.05	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0710	-3.00	7Y	-30.85	1.00	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.2100	-2.70	10Y	-34.75	0.45	-12.95	-38.70	6.00	-38.70	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1122.00	(+2.50)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-61.00	-1.00	0.8300	-2.00	1.4000	0.7650	1*2Y	13.00	0.50	
1.5Y	-58.50	0.00	0.8950	-1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	9.50	-0.50	
2Y	-55.75	0.25	0.9600	-1.50	1.2250	0.7950	2*5Y	17.00	-0.50	
3Y	-53.00	0.25	1.0550	-2.00	1.3150	0.7350	3*4Y	6.00	0.50	
4Y	-52.50	0.75	1.1150	-1.50	1.3750	0.6900	3*5Y	7.50	0.00	
5Y	-55.75	0.25	1.1300	-2.00	1.4350	0.6600	4*5Y	1.50	-0.50	
7Y	-60.25	0.00	1.1600	-2.00	1.4500	0.6550	5*7Y	3.00	0.00	
10Y	-56.25	0.25	1.3000	-2.00	1.9050	0.6300	5*10Y	17.00	0.00	

TODAY DEAL LEVEL								
IRS	Lv.		ODD Tenor					
06M								
09M	41.75 / 42.25							
01Y	44 / 44.25							
1.5Y	48.5 / 48.75							
02Y	52		SPRD	1*2y	08			
03Y	59 / 60.5			2*3y	07			
04Y	64.75							
05Y	69. 25							
07Y								
10Y	87							
12Y								
15Y								
20Y								
CRS	3y 5.5							
TODAY KRX CCP			국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	62건 (-9건)		KTB	109.61	0.08	109.56	109.62	109.53
금 액	20,680억원 (+2,210억원)		LKTB	124.05	-0.76	124.86	125.07	124.79

장중동향

금일 채권은 전일 막판 가격이 하락한데에 대한 반발 매수와 안전자산 선호심리로 강세. 3년선물과, 10년선물 모두 외 국인의 순매수로 꾸준히 상승하며 3선은 8틱상승한 109.61 10선은 24틱 상승한 125.05로 마감.

IRS는 국채선물과 현물의 매수에 힘입어 전반적으로 하락. 강세속에서도 단기쪽은 비교적 비드가 있었던 반면, 아웃 라잇은 오퍼가 우위를 보이고 10년으로 엔디 오퍼가 꾸준히 내려오면서 커브는 플랫트닝 마감.

CRS는 1.5~2bp 하락 마감.

ETC