

IPS Daily Closing Brief

2017-06-05

IRS			91d CD			1.38	(0.00)	CALL	1.22	(-0.02)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.3900	0.00	1.3925	1.4041	1.4408	1.6550	1.2875	2.7950	1.2875	
9M	1.4100	0.00	1.4145	1.4290	1.4603	1.6350	1.2500	2.7900	1.2500	
1Y	1.4350	-0.25	1.4415	1.4564	1.4796	1.6325	1.2200	2.8150	1.2200	
1.5Y	1.4700	-0.50	1.4820	1.5000	1.5191	1.6450	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5000	-1.25	1.5190	1.5385	1.5549	1.6600	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.5600	-1.75	1.5865	1.6114	1.6225	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6150	-2.00	1.6415	1.6671	1.6772	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.6600	-2.25	1.6890	1.7188	1.7271	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7300	-2.75	1.7620	1.7936	1.8035	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8275	-2.75	1.8620	1.8989	1.9038	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.8650	-2.75	1.8995	1.9355	1.9410	2.0800	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.8725	-3.00	1.9090	1.9423	1.9447	2.1075	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.8775	-3.00	1.9140	1.9454	1.9341	2.1375	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	2.00	0.00	2.20	2.49	1.95	3.25	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	2.50	-0.25	2.70	2.74	1.93	3.25	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	6.50	-1.00	7.75	8.21	7.53	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	6.00	-0.50	6.75	7.29	6.76	8.50	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	11.50	-0.75	12.25	12.86	12.23	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	16.00	-1.00	17.00	18.03	17.22	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.50	-0.25	5.50	5.58	5.47	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	10.00	-0.50	10.25	10.74	10.46	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	4.50	-0.25	4.75	5.16	4.99	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	7.00	-0.50	7.30	7.49	7.65	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	16.75	-0.50	17.30	18.01	17.67	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	9.75	0.00	10.00	10.53	10.03	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.66	3.73	5.50	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.50	-0.25	4.70	4.34	4.09	8.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	5.00	-0.25	5.20	4.65	3.03	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	0.00	1Y	0.40	-0.25	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5170	0.00	1.5Y	-4.70	-0.50	-0.10	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.5770	0.00	2Y	-7.70	-1.25	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6170	-0.80	3Y	-5.70	-0.95	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.7600	-0.70	4Y	-14.50	-1.30	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8320	-1.00	5Y	-17.20	-1.25	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0390	-2.00	7Y	-30.90	-0.75	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.1750	-2.20	10Y	-34.75	-0.55	-12.95	-38.70	6.00	-38.70	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1118.30	(-3.50)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-63.00	-0.75	0.8050	-1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	12.00	-1.00	
1.5Y	-61.00	-1.50	0.8600	-2.00	1.2850	0.8100	2*3Y	9.50	-0.50	
2Y	-57.50	-0.75	0.9250	-2.00	1.2250	0.7950	2*5Y	16.50	-1.00	
3Y	-54.00	-0.75	1.0200	-2.50	1.3150	0.7350	3*4Y	6.00	0.00	
4Y	-53.50	-0.50	1.0800	-2.50	1.3750	0.6900	3*5Y	7.00	-0.50	
5Y	-57.00	-0.75	1.0900	-3.00	1.4350	0.6600	4*5Y	1.00	-0.50	
7Y	-62.00	-1.25	1.1100	-4.00	1.4500	0.6550	5*7Y	2.00	-1.00	
10Y	-58.75	-2.25	1.2400	-5.00	1.9050	0.6300	5*10Y	15.00	-2.00	

TODAY DEAL LEVEL									
IRS	Lv.				ODD Tenor				
06M	39								
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	50 / 50.25				SPRD	9M*1.5Y 06			
03Y	56.25 / 56.75					1*2Y 6.5			
04Y						2*3Y 06			
05Y									
07Y									
10Y	83.5								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	5Y 9.5								
	7Y 12								
	5*7Y 2.5								
TODAY KRX CCP				국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황		59건 (+11건)		KTB	109.70	0.05	109.70	109.71	109.67
금 액		16,335억원 (+4,325원)		LKTB	125.43	0.29	125.43	125.48	125.30

장중동향

지급준비일과, 공휴일을 앞두고 거래가 부진한 가운데 최근 분위기를 이끌고 있는 외인 매매 동향을 지켜보면서 시장은 소강 분위기.

IRS, 글로벌 금리 강세 분위기와 선물 강세 속 오퍼가 우위 보이며 커브 플랫트닝. 오전은 입찰 앞두고 조용한 가운데 3Y이 56.75(-1.00) 몇 번 거래되는 정도. 국고 3년물 입찰이 무난하게 되면서 오후들어 1*2Y이 6.50 (-1.50)에 여러번 거래. 오퍼가 강한 탓에 거래는 주로 비드가 나오면 기본되는 양상을 보임.

CRS, 5일 연속 레벨 하락 마감. 최근 에셋스왑, FX스왑 하락 등이 CRS 레벨을 끌어내리고 있는 가운데 이날은 10년 금리 위주로 레벨 하락. 부채 비드가 간간히 나왔지만, 오퍼가 더 강하게 나오면서 강세로 마감.

ETC

- * [10:00~10:10] 동안 182d(17.12.4) 7000억 입찰 ★1.30% 낙찰
- * [10:40~11:00] 국고 3y(17-2) 1조 8000억 입찰 ★1.65% 낙찰
- * [13:30~13:40] 동안 91d(17.9.4) 1조 2000억 입찰 ★1.29% 낙찰