

IPS Daily Closing Brief

2017-06-07

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	1.3925	0.25	1.3925	1.4026	1.4388	1.6550	1.2875	2.7950	1.2875	
9M	1.4125	0.25	1.4135	1.4271	1.4584	1.6300	1.2500	2.7900	1.2500	
1Y	1.4350	0.00	1.4395	1.4540	1.4778	1.6275	1.2200	2.8150	1.2200	
1.5Y	1.4700	0.00	1.4780	1.4971	1.5171	1.6375	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5000	0.00	1.5130	1.5351	1.5526	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.5550	-0.50	1.5770	1.6071	1.6200	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6050	-1.00	1.6315	1.6626	1.6745	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.6475	-1.25	1.6775	1.7138	1.7242	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7150	-1.50	1.7495	1.7880	1.8005	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8075	-2.00	1.8475	1.8926	1.9006	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.8450	-2.00	1.8850	1.9291	1.9378	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.8525	-2.00	1.8940	1.9361	1.9416	2.0675	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.8575	-2.00	1.8990	1.9396	1.9321	2.0975	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	2.00	0.00	2.10	2.45	1.95	3.25	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	2.25	-0.25	2.60	2.69	1.94	3.25	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	6.50	0.00	7.35	8.11	7.49	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	5.50	-0.50	6.40	7.20	6.73	8.50	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	10.50	-1.00	11.85	12.75	12.18	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	14.75	-1.25	16.45	17.86	17.16	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.00	-0.50	5.45	5.55	5.45	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	9.25	-0.75	10.05	10.66	10.43	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	4.25	-0.25	4.60	5.11	4.98	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	6.75	-0.25	7.20	7.43	7.63	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	16.00	-0.75	17.00	17.89	17.64	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	9.25	-0.50	9.80	10.46	10.02	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.65	3.72	5.50	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.50	0.00	4.65	4.35	4.10	8.00	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	5.00	0.00	5.15	4.70	3.15	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	1.4320	0.10	1Y	0.30	-0.10	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5320	1.50	1.5Y	-6.20	-1.50	-0.10	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.5800	0.30	2Y	-8.00	-0.30	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6220	0.50	3Y	-6.70	-1.00	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.7600	0.00	4Y	-15.50	-1.00	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8300	-0.20	5Y	-18.25	-1.05	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0310	-0.80	7Y	-31.60	-0.70	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.1570	-1.80	10Y	-34.95	-0.20	-12.95	-38.70	6.00	-38.70	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1124.00	(+5.70)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-62.50	0.50	0.8100	0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	12.00	0.00	
1.5Y	-60.50	0.50	0.8650	0.50	1.2850	0.8100	2*3Y	8.50	-1.00	
2Y	-57.00	0.50	0.9300	0.50	1.2250	0.7950	2*5Y	15.00	-1.50	
3Y	-54.00	0.00	1.0150	-0.50	1.3150	0.7350	3*4Y	5.50	-0.50	
4Y	-53.50	0.00	1.0700	-1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	6.50	-0.50	
5Y	-56.75	0.25	1.0800	-1.00	1.4350	0.6600	4*5Y	1.00	0.00	
7Y	-61.00	1.00	1.1050	-0.50	1.4500	0.6550	5*7Y	2.50	0.50	
10Y	-58.75	0.00	1.2200	-2.00	1.9050	0.6300	5*10Y	14.00	-1.00	

TODAY DEAL LEVEL								
IRS	Lv.		ODD Tenor					
06M	39.25 / 39							
09M	41.25							
01Y	43.25 / 43.5							
1.5Y	47							
02Y	49.75 / 50 / 50.25		SPRD	1*2Y	6.5 / 6.75			
03Y	55.75			6*9M	1.75			
04Y	60.5			9*12M	2.25			
05Y	65							
07Y								
10Y								
12Y								
15Y								
20Y								
CRS								
TODAY KRX CCP			국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황			KTB	109.69	-0.01	109.70	109.72	109.68
금 액			LKTB	125.60	0.17	125.45	125.61	125.43

장중동향

IRS는 오전에 단기쪽 스프레드가 스몰로 간간이 거래가 이루어졌다. 대외 이벤트를 앞두고 전반적으로 조용한 모습을 보였고 장기구간을 중심으로 하락 마감.

CRS 금리는 단기구간은 소폭 상승하고 중·장기 구간은 하락 마감.

ETC

- ★[10:00 ~ 10:10] 통안 2y(통막, 19.6.2) 2.8조 입찰
- ★[10:40 ~ 11:00] 국고 30y(17-1) 1.45조 입찰