IPS Daily Closing Brief

2017-06-08

IRS				91d CD	0.00	(-1.38)	CALL	0	(-1.23)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3950	0.25	1.3920	1.4008	1.4368	1.6550	1.2875	2.7950	1.2875
9M	1.4150	0.25	1.4120	1.4246	1.4564	1.6225	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4400	0.50	1.4375	1.4511	1.4759	1.6175	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.4775	0.75	1.4745	1.4935	1.5152	1.6250	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5100	1.00	1.5080	1.5309	1.5505	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.5675	1.25	1.5690	1.6018	1.6175	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6175	1.25	1.6225	1.6569	1.6718	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.6600	1.25	1.6675	1.7073	1.7213	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7300	1.50	1.7390	1.7808	1.7973	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8225	1.50	1.8350	1.8841	1.8974	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.8600	1.50	1.8725	1.9208	1.9349	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.8675	1.50	1.8810	1.9280	1.9385	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.8725	1.50	1.8860	1.9319	1.9292	2.0650	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	0.00	-2.00	2.00	2.41	1.96	3.25	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	0.00	-2.25	2.56	2.66	1.94	3.25	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	0.00	-6.50	7.06	8.03	7.47	9.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	0.00	-5.50	6.19	7.16	6.72	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	0.00	-10.50	11.63	12.70	12.15	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	0.00	-14.75	16.19	17.78	17.11	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	0.00	-5.00	5.44	5.54	5.43	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	0.00	-9.25	10.00	10.62	10.39	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	0.00	-4.25	4.56	5.08	4.96	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	0.00	-6.75	7.19	7.37	7.62	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	0.00	-16.00	16.88	17.76	17.64	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	0.00	-9.25	9.69	10.39	10.02	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	0.00	-3.75	3.75	3.66	3.75	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	0.00	-4.50	4.63	4.38	4.10	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	0.00	-5.00	5.13	4.76	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	1.4300	-0.20	1Y	1.00	0.70	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5350	0.30	1.5Y	-5.75	0.45	-0.10	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.5900	1.00	2Y	-8.00	0.00	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6350	1.30	3Y	-6.75	-0.05	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.7820	2.20	4Y	-16.45	-0.95	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8550	2.50	5Y	-19.50	-1.25	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0470	1.60	7Y	-31.70	-0.10	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.1720	1.50	10Y	-34.95	0.00	-12.95	-38.70	6.00	-38.70

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1122.10	(-1.90)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-62.00	0.50	0.8200	1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	12.50	0.50
1.5Y	-60.25	0.25	0.8750	1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	9.00	0.50
2Y	-56.50	0.50	0.9450	1.50	1.2250	0.7950	2*5Y	17.00	2.00
3Y	-53.25	0.75	1.0350	2.00	1.3150	0.7350	3*4Y	6.00	0.50
4Y	-52.25	1.25	1.0950	2.50	1.3750	0.6900	3*5Y	8.00	1.50
5Y	-54.50	2.25	1.1150	3.50	1.4350	0.6600	4*5Y	2.00	1.00
7Y	-59.00	2.00	1.1400	3.50	1.4500	0.6550	5*7Y	2.50	0.00
10Y	-56.75	2.00	1.2550	3.50	1.9050	0.6300	5*10Y	14.00	0.00

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	6y 69.75
09M			
01Y	43.5 / 44		
1.5Y	47.75 / 48		
02Y	51	SPRD	1*3y 12.75
03Y	56 / 56.5 / 56.75		1.5*3y 09
04Y			2*10y 30.5
05Y			3*10y 25.25
07Y			
10Y	80.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	44건 (-53건)	KTB	109.64	-0.05	109.67	109.68	109.63
금 액	15,335억원 (-9,284억원)	LKTB	125.47	-0.13	125.50	125.60	125.32

장중동향

금일 채권시장은 약보합으로 시작하여, BOJ 출구전략 입장 변화설에 오후부터 낙폭이 커지면서 약세장으로 마감.

IRS는 오랜만에 한산한 분위기속에 거래가 적었고, 채권과 연동해 금리 상승 마감. CCP거래보다는 엔디 거래가 활발하게 보였고, 3년과 10년으로 엔디거래가 많이 보임.

CRS도 중장기물을 중심으로 상승하며 커브 스티프닝 마감.

ETC