

IPS Daily Closing Brief

2017-06-12

IRS			91d CD			1.38	(0.00)	CALL	1.24	(+0.01)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.4000	0.50	1.3945	1.3988	1.4332	1.6550	1.2875	2.7950	1.2875	
9M	1.4325	1.75	1.4170	1.4220	1.4531	1.6200	1.2500	2.7900	1.2500	
1Y	1.4650	2.75	1.4425	1.4483	1.4730	1.6075	1.2200	2.8150	1.2200	
1.5Y	1.5125	3.50	1.4815	1.4900	1.5125	1.6125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5500	4.00	1.5140	1.5264	1.5476	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6150	4.50	1.5735	1.5954	1.6140	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6625	4.50	1.6235	1.6493	1.6675	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.7050	4.50	1.6665	1.6983	1.7165	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7775	4.75	1.7365	1.7706	1.7920	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8725	4.75	1.8310	1.8720	1.8917	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.9100	4.75	1.8685	1.9088	1.9292	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9175	4.75	1.8760	1.9165	1.9333	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.9250	4.75	1.8820	1.9214	1.9259	2.0550	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	3.25	1.25	2.25	2.33	1.99	3.25	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	3.25	1.00	2.55	2.63	1.99	3.25	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	8.50	1.25	7.15	7.81	7.46	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	6.50	0.50	5.95	6.90	6.64	8.50	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	11.25	0.50	10.95	12.29	11.99	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	15.50	0.50	15.25	17.19	16.89	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	4.75	0.00	5.00	5.39	5.35	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	9.00	0.00	9.30	10.29	10.25	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	4.25	0.00	4.30	4.90	4.90	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	7.25	0.25	7.00	7.24	7.55	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	16.75	0.25	16.45	17.38	17.52	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	9.50	0.00	9.45	10.14	9.96	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.75	0.00	3.75	3.68	3.75	5.50	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.50	0.00	4.50	4.45	4.16	8.00	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	5.25	0.00	5.10	4.94	3.42	11.25	-11.00	31.00	-11.00	
BOND			BOND SWAP SPRD			(1-2Y 동안 3-10Y 국고,금투현 시가평가 민평평균 기준)				
Tenor	Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
1Y	1.4450	2.00	1Y	2.00	0.75	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5600	3.00	1.5Y	-4.75	0.50	-0.10	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6200	3.30	2Y	-7.00	0.70	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6950	6.50	3Y	-8.00	-2.00	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.8270	5.20	4Y	-16.45	-0.70	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.9050	5.80	5Y	-20.00	-1.30	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0970	5.30	7Y	-31.95	-0.55	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.2150	4.50	10Y	-34.25	0.25	-12.95	-38.70	6.00	-38.70	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1127.30	(+4.10)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-59.50	0.25	0.8700	3.00	1.4000	0.7650	1*2Y	15.00	2.00	
1.5Y	-57.75	0.50	0.9350	4.00	1.2850	0.8100	2*3Y	11.00	2.00	
2Y	-53.00	1.00	1.0200	5.00	1.2250	0.7950	2*5Y	22.50	4.00	
3Y	-48.50	2.50	1.1300	7.00	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	1.00	
4Y	-45.75	3.50	1.2050	8.00	1.3750	0.6900	3*5Y	11.50	2.00	
5Y	-46.00	4.50	1.2450	9.00	1.4350	0.6600	4*5Y	4.00	1.00	
7Y	-51.25	3.75	1.2650	8.50	1.4500	0.6550	5*7Y	2.00	-0.50	
10Y	-49.75	3.25	1.3750	8.00	1.9050	0.6300	5*10Y	13.00	-1.00	

TODAY DEAL LEVEL							
IRS	Lv.	ODD Tenor					
06M	41						
09M	43.75 / 44						
01Y	45.5 / 45.75						
1.5Y	50 / 51.25						
02Y	53.5 / 54 / 54.75 / 55	SPRD	6*12M 4.5 / 4.75 / 6.5				
03Y	60.25 / 61.5 / 61.75		1*2Y 08 / 8.25 / 8.5				
04Y			1*7Y 30.75				
05Y	71		1.5*3Y 10.25				
07Y			2*3Y 6.25				
10Y							
12Y							
15Y							
20Y							
CRS							
TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황		KTB	109.48	-0.18	109.64	109.64	109.44
금 액		LKTB	124.91	-0.55	125.40	125.45	124.74

장중동향

국고채 금리, FOMC를 앞두고 이주열 한은 총재의 통화긴축 시사 발언 영향으로 상승 마감. 특히 외인이 국채선물 3년,10년물을 대규모 순매도 하면서 약세 폭을 키움. 지난 11거래일 동안 꾸준히 매수했던 국채선물 손절매에 나선 것으로 추정.

오전에 있었던 국고 5년물 (16-10) 1조9천억원 입찰은 1.885%(민평+3.5bp)에 낙찰되면서 호조를 보였다는 평가. FOMC를 앞두고 비경쟁인수물량을 노린 옵션 수요가 들어온 것으로 해석.

IRS, 국채선물 급락 영향 등으로 상승 마감.
 시차를 두고 금리가 상승해 현물 채권 금리 상승폭을 쫓아가지 못하면서 본드스왑 역전폭이 확대.
 전반적으로 6m-3Y까지 짧은 구간에서 거래 활발. 비드가 많아 오퍼가 나오면 테이크 되는 분위기.
 특히 1-2Y 구간 거래가 활발했으며, 1Y 45.5~45.75 / 2Y 53.5~55 / 1*2Y 08~8.5 까지 여러 번 거래.

CRS, 부채스왑 물량으로 금리 상승 마감. 3년물 위주로 국내기관의 거래가 잦았던 것으로 추측.

ETC

- * [10:00 ~ 10:10] 동안 1y(18.6.9 만기) 1.4조 입찰 ★1.460% 낙찰
- * [10:40 ~ 11:00] 국고 5y(16-10) 1.9조 입찰 ★1.885% 낙찰
- * [13:30 ~ 13:40] 동안 91d(17.9.12 만기) 1.2조 입찰 ★1.270% 낙찰