IPS Daily Closing Brief

2017-06-15

IRS				91d CD	1.38	(0.00)	CALL	1.23	(0.00)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4000	0.00	1.3980	1.3971	1.4281	1.6550	1.2875	2.7950	1.2875
9M	1.4325	0.00	1.4275	1.4211	1.4490	1.6200	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4650	0.00	1.4580	1.4484	1.4698	1.6075	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.5100	0.00	1.5025	1.4900	1.5098	1.6125	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5400	-0.25	1.5355	1.5251	1.5445	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.5950	-0.75	1.5955	1.5905	1.6101	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6300	-1.75	1.6405	1.6418	1.6625	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.6625	-2.25	1.6795	1.6880	1.7107	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7050	-3.25	1.7390	1.7566	1.7846	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.7825	-4.00	1.8275	1.8544	1.8835	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.8175	-4.00	1.8635	1.8910	1.9210	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.8250	-4.00	1.8710	1.8994	1.9258	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.8250	-4.75	1.8770	1.9049	1.9212	2.0500	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	3.25	0.00	2.95	2.40	2.08	3.25	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	3.25	0.00	3.05	2.73	2.08	3.25	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	7.50	-0.25	7.75	7.68	7.47	9.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	5.50	-0.50	6.00	6.54	6.57	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	9.00	-1.50	10.50	11.66	11.81	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	12.25	-2.00	14.40	16.29	16.63	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	3.50	-1.00	4.50	5.13	5.24	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	6.75	-1.50	8.40	9.75	10.06	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.25	-0.50	3.90	4.63	4.82	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	4.25	-1.00	5.95	6.86	7.39	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	12.00	-1.75	14.80	16.64	17.28	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	7.75	-0.75	8.85	9.78	9.90	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.00	3.60	3.66	3.74	5.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.35	4.50	4.22	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.25	-0.75	4.95	5.05	3.77	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	0.00	1Y	3.30	0.00	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5620	0.50	1.5Y	-5.20	-0.50	-0.10	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.6160	0.10	2Y	-7.60	-0.35	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6800	-0.20	3Y	-8.50	-0.55	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.7820	-1.30	4Y	-15.20	-0.45	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8500	-2.00	5Y	-18.75	-0.25	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0240	-2.70	7Y	-31.90	-0.55	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.1250	-3.70	10Y	-34.25	-0.30	-12.95	-38.70	6.00	-38.70

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1124.10	(+0.20)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-64.00	-0.50	0.8250	-0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	14.00	1.50
1.5Y	-62.00	0.50	0.8900	0.50	1.2850	0.8100	2*3Y	9.00	0.00
2Y	-57.50	1.25	0.9650	1.00	1.2250	0.7950	2*5Y	20.00	0.00
3Y	-54.00	1.75	1.0550	1.00	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	0.00
4Y	-50.00	2.75	1.1300	1.00	1.3750	0.6900	3*5Y	11.00	0.00
5Y	-49.75	3.25	1.1650	1.00	1.4350	0.6600	4*5Y	3.50	0.00
7Y	-51.00	4.75	1.1950	1.50	1.4500	0.6550	5*7Y	3.00	0.50
10Y	-49.25	5.00	1.2900	1.00	1.9050	0.6300	5*10Y	12.50	0.00

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M	40	ODD Tenor	
09M	43.5		
01Y	47 / 46.75		
1.5Y	51		
02Y	54 / 54.25 /53.75	SPRD	5*7y @ 4.25
03Y	59		
04Y			5*10y @ 11.5
05Y	68 / 67.5 / 66.5		
07Y			10*20y @ 4.5
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y @ 82		

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	105건 (+12건)	KTB	109.58	0.02	109.62	109.64	109.57
금 액	21,806억원 (-3,371억원)	LKTB	125.83	0.37	125.85	126.06	125.71

장중동향

IRS 금리는 미국의 정책금리 인상에 따른 불확실성 해소로 수익률 곡선이 평탄해짐. FOMC의 금리인상 이후 국채선물이 강세를 보이며 비드가 상당히 나옴. 오후들어 수익률 곡선이 눌리면서 간간이 오퍼가 나오면서 간간이 거래됨.

CRS시장은 미국의 예상된 금리 인상이 별다른 영향을 주지 않은 채 보합권 내에서 움직였다. 혼조세를 보이다 마감.

ETC