

IPS Daily Closing Brief

2017-06-20

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	1.4075	0.00	1.4020	1.3976	1.4254	1.6550	1.2875	2.7950	1.2875	
9M	1.4400	0.00	1.4340	1.4226	1.4470	1.6200	1.2500	2.7900	1.2500	
1Y	1.4800	0.00	1.4695	1.4514	1.4688	1.6050	1.2200	2.8150	1.2200	
1.5Y	1.5225	-0.25	1.5140	1.4934	1.5090	1.6075	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5525	-0.50	1.5455	1.5284	1.5436	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6100	-0.50	1.6035	1.5923	1.6091	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6500	-0.50	1.6455	1.6420	1.6610	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.6850	-0.50	1.6815	1.6865	1.7087	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7350	-0.50	1.7325	1.7530	1.7815	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8150	-0.75	1.8155	1.8485	1.8801	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.8500	-0.75	1.8505	1.8850	1.9175	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.8625	-0.75	1.8600	1.8939	1.9228	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.8625	-0.75	1.8630	1.8989	1.9195	2.0500	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	3.25	0.00	3.20	2.50	2.16	3.25	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	4.00	0.00	3.55	2.88	2.18	4.00	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	7.25	-0.50	7.60	7.70	7.48	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	5.75	0.00	5.80	6.39	6.55	8.50	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	9.75	0.00	10.00	11.36	11.75	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	13.25	0.00	13.60	15.81	16.51	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	4.00	0.00	4.20	4.98	5.20	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	7.50	0.00	7.80	9.43	9.96	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	3.50	0.00	3.60	4.45	4.77	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	5.00	0.00	5.10	6.65	7.28	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	13.00	-0.25	13.40	16.20	17.14	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	8.00	-0.25	8.30	9.55	9.85	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.50	0.00	3.50	3.65	3.74	5.50	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.75	0.00	4.45	4.54	4.27	8.00	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	4.75	0.00	4.75	5.04	3.94	11.25	-11.00	31.00	-11.00	
BOND			BOND SWAP SPRD			(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투현 시가평가 민평평균 기준)				
Tenor	Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
1Y	1.4320	-0.50	1Y	4.80	0.50	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5630	-0.70	1.5Y	-4.05	0.45	-0.10	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6120	-1.00	2Y	-5.95	0.50	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6820	-1.50	3Y	-7.20	1.00	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.7870	-1.30	4Y	-13.70	0.80	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8550	-1.50	5Y	-17.00	1.00	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0480	-0.50	7Y	-31.30	0.00	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.1550	-0.40	10Y	-34.00	-0.35	-12.95	-38.70	6.00	-38.70	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1132.70	(-1.40)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-63.00	-0.50	0.8500	-0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	12.00	-1.00	
1.5Y	-61.75	-0.75	0.9050	-1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	8.00	-1.00	
2Y	-58.25	-1.00	0.9700	-1.50	1.2250	0.7950	2*5Y	18.00	-2.00	
3Y	-56.00	-2.00	1.0500	-2.50	1.3150	0.7350	3*4Y	6.50	-1.00	
4Y	-53.50	-3.00	1.1150	-3.50	1.3750	0.6900	3*5Y	10.00	-1.00	
5Y	-53.50	-3.00	1.1500	-3.50	1.4350	0.6600	4*5Y	3.50	0.00	
7Y	-55.50	-3.00	1.1800	-3.50	1.4500	0.6550	5*7Y	3.00	0.00	
10Y	-54.00	-2.75	1.2750	-3.50	1.9050	0.6300	5*10Y	12.50	0.00	

TODAY DEAL LEVEL							
IRS	Lv.	ODD Tenor					
06M							
09M							
01Y	47.75						
1.5Y							
02Y		SPRD	1*2Y 7.75				
03Y	61		4*10Y 16.5				
04Y							
05Y	68.25						
07Y	74.25						
10Y							
12Y							
15Y							
20Y							
CRS							
TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	61건 (-42건)	KTB	109.58	0.05	109.53	109.59	109.51
금 액	13,155억원 (-18,398억원)	LKTB	125.50	0.10	125.45	125.53	125.30

장중동향

국고채 금리, 미국 금리 하락 속에서도 국고채 10년물 입찰 부진 영향으로 혼조세. 국채선물은 강세로 출발했지만 오전 내내 국고 10년물 입찰 대기로 눈치보기 장세가 이어짐.

IRS, 장중 채권 현물 흐름에 연동되면서 소폭 하락 마감. 커브 플레트닝. 스왑시장은 호가 대치가 간간이 되기는 하나 거래는 별로 없이 조용했던 장.

CRS, 에셋스왑 물량이 유입되면서 중장기구간 위주로 강세를 보이며 금리 하락 마감.

ETC

[10:00~10:10] 통안 182d(17.12.19) 7000억 입찰 ★1.30% 낙찰
 [10:40~11:00] 국고 10y(17-3) 1조 8000억 입찰 ★2.170% 낙찰
 [13:30~13:40] 통안 91d(17.09.19) 1조 1000억 입찰 ★1.30% 낙찰