

IPS Daily Closing Brief

2017-06-20

IRS			91d CD			1.38	(0.00)	CALL	0	(-1.23)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.4075	0.00	1.4045	1.3979	1.4240	1.6425	1.2875	2.7950	1.2875	
9M	1.4400	0.00	1.4370	1.4234	1.4459	1.6050	1.2500	2.7900	1.2500	
1Y	1.4800	0.00	1.4740	1.4529	1.4683	1.5900	1.2200	2.8150	1.2200	
1.5Y	1.5275	0.50	1.5190	1.4951	1.5086	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5575	0.50	1.5500	1.5298	1.5431	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6150	0.50	1.6075	1.5930	1.6085	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6550	0.50	1.6475	1.6421	1.6603	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.6900	0.50	1.6825	1.6858	1.7076	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7425	0.75	1.7320	1.7511	1.7800	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8225	0.75	1.8130	1.8454	1.8783	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.8550	0.50	1.8475	1.8818	1.9155	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.8575	-0.50	1.8560	1.8904	1.9209	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.8575	-0.50	1.8575	1.8951	1.9181	2.0500	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	3.25	0.00	3.25	2.55	2.20	3.25	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	4.00	0.00	3.70	2.95	2.23	4.00	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	7.75	0.50	7.60	7.69	7.49	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	5.75	0.00	5.75	6.33	6.54	8.50	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	9.75	0.00	9.75	11.24	11.71	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	13.25	0.00	13.25	15.60	16.45	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	4.00	0.00	4.00	4.91	5.17	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	7.50	0.00	7.50	9.28	9.91	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	3.50	0.00	3.50	4.36	4.74	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	5.25	0.25	4.95	6.54	7.24	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	13.25	0.25	13.05	15.96	17.06	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	8.00	0.00	8.10	9.43	9.83	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.25	-0.25	3.45	3.64	3.73	5.50	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	3.50	-1.25	4.30	4.50	4.26	8.00	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	3.50	-1.25	4.45	4.98	3.99	11.25	-11.00	31.00	-11.00	
BOND			BOND SWAP SPRD			(1-2Y 동안 3-10Y 국고금투현 시가평가 민평평균 기준)				
Tenor	Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
1Y	1.4320	0.00	1Y	4.80	0.00	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5620	-0.10	1.5Y	-3.45	0.60	-0.10	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6170	0.50	2Y	-5.95	0.00	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6820	0.00	3Y	-6.70	0.50	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.7820	-0.50	4Y	-12.70	1.00	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8470	-0.80	5Y	-15.70	1.30	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0390	-0.90	7Y	-29.65	1.65	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.1400	-1.50	10Y	-31.75	2.25	-12.95	-38.70	6.00	-38.70	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1135.40	(+2.70)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-61.50	1.50	0.8650	1.50	1.4000	0.7650	1*2Y	12.00	0.00	
1.5Y	-60.75	1.00	0.9200	1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	8.00	0.00	
2Y	-57.25	1.00	0.9850	1.50	1.2250	0.7950	2*5Y	18.50	0.50	
3Y	-55.00	1.00	1.0650	1.50	1.3150	0.7350	3*4Y	7.50	1.00	
4Y	-51.50	2.00	1.1400	2.50	1.3750	0.6900	3*5Y	10.50	0.50	
5Y	-52.00	1.50	1.1700	2.00	1.4350	0.6600	4*5Y	3.00	-0.50	
7Y	-54.25	1.25	1.2000	2.00	1.4500	0.6550	5*7Y	3.00	0.00	
10Y	-52.75	1.25	1.2950	2.00	1.9050	0.6300	5*10Y	12.50	0.00	

TODAY DEAL LEVEL									
IRS		Lv.		ODD Tenor					
06M									
09M									
01Y		48.125 / 4825							
1.5Y		52.75							
02Y		55.75 / 56 / 56.25		SPRD	2*3y		5.75		
03Y		61.2 / 61.75			2*4y		10		
04Y		65.5			4*10y		16.5		
05Y		68.75 / 69			5*10y		13.5		
07Y		75			7*10y		08		
10Y		81.5 / 82 / 83			10*15y		4.5 4.25 04 3.75		
12Y					10*20y		4.5		
15Y									
20Y									
CRS		3y 65 / 07							
TODAY KRX CCP				국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황		100건 (+39건)		KTB	109.44	-0.14	109.41	109.45	109.38
금 액		18,949억원 (+5,794억원)		LKTB	125.39	-0.11	125.05	125.43	125.00

장중동향

금일 채권시장은 미국 금리 상승을 반영해 약세를 보이다가 국채선물 월물교체 후 강세를 보이며 외국인들이 급격하게 매수. 특히 장기물이 강세 흐름.

IRS는 오전내 비드 우위를 보이며 특히 1년부터 3년구간이 비디시하게 거래. 4*10y, 5*10y, 7*10y등 10년관련스플래 활동. 특히 초장기쪽 커브 오퍼가 강하게 내려오며 10*15y이 4.5부터 거래되며 내려와 3.5로 마감해 초장기 커브만 플랫폼 마감. 외국인들이 적극적으로 커브 플랫폼에 베팅하는 모습.

CRS는 3년물의 거래가 활발 6.5/07 레벨에서 거래. 부채물량으로 레벨이 상승했지만 오퍼도 제법 나오며 거래.

ETC