

IPS Daily Closing Brief

2017-06-21

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	1.4100	0.25	1.4065	1.3985	1.4227	1.6425	1.2875	2.7950	1.2875	
9M	1.4450	0.50	1.4395	1.4246	1.4450	1.6050	1.2500	2.7900	1.2500	
1Y	1.4850	0.50	1.4780	1.4549	1.4679	1.5900	1.2200	2.8150	1.2200	
1.5Y	1.5350	0.75	1.5240	1.4976	1.5085	1.6025	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5650	0.75	1.5545	1.5320	1.5431	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6225	0.75	1.6115	1.5948	1.6085	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6600	0.50	1.6500	1.6431	1.6600	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.6925	0.25	1.6840	1.6860	1.7070	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7425	0.00	1.7330	1.7503	1.7791	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8175	-0.50	1.8120	1.8431	1.8770	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.8500	-0.50	1.8460	1.8794	1.9143	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.8500	-0.75	1.8530	1.8876	1.9196	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.8500	-0.75	1.8530	1.8921	1.9173	2.0500	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	3.50	0.25	3.30	2.61	2.24	3.50	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	4.00	0.00	3.85	3.03	2.28	4.00	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	8.00	0.25	7.65	7.71	7.52	9.75	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	5.75	0.00	5.70	6.28	6.54	8.50	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	9.50	-0.25	9.55	11.11	11.69	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	12.75	-0.50	12.95	15.40	16.39	21.00	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	3.75	-0.25	3.85	4.84	5.15	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	7.00	-0.50	7.25	9.13	9.85	14.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	3.25	-0.25	3.40	4.29	4.70	6.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	5.00	-0.25	4.90	6.43	7.21	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	12.50	-0.75	12.80	15.71	17.00	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	7.50	-0.50	7.90	9.29	9.80	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	3.25	0.00	3.40	3.63	3.73	5.50	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	3.25	-0.25	4.10	4.45	4.26	8.00	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	3.25	-0.25	4.10	4.90	4.03	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	1.4400	0.80	1Y	4.50	-0.30	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5670	0.50	1.5Y	-3.20	0.25	-0.10	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6300	1.30	2Y	-6.50	-0.55	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6900	0.80	3Y	-6.75	-0.05	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.7900	0.80	4Y	-13.00	-0.30	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8570	1.00	5Y	-16.45	-0.75	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0370	-0.20	7Y	-29.45	0.20	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.1350	-0.50	10Y	-31.75	0.00	-12.95	-38.70	6.00	-38.70	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			0.00 (-1135.40)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-63.00	-1.50	0.8550	-1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	11.00	-1.00
1.5Y	-63.00	-2.25	0.9050	-1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	8.00	0.00
2Y	-60.00	-2.75	0.9650	-2.00	1.2250	0.7950	2*5Y	17.50	-1.00
3Y	-57.75	-2.75	1.0450	-2.00	1.3150	0.7350	3*4Y	7.00	-0.50
4Y	-54.50	-3.00	1.1150	-2.50	1.3750	0.6900	3*5Y	9.50	-1.00
5Y	-55.25	-3.25	1.1400	-3.00	1.4350	0.6600	4*5Y	2.50	-0.50
7Y	-57.25	-3.00	1.1700	-3.00	1.4500	0.6550	5*7Y	3.00	0.00
10Y	-55.25	-2.50	1.2650	-3.00	1.9050	0.6300	5*10Y	12.50	0.00

TODAY DEAL LEVEL							
IRS	Lv.	ODD Tenor					
06M							
09M	44.25						
01Y	48.25						
1.5Y	53 / 53.25 / 53.5						
02Y	55.75 / 56 / 56.25	SPRD	1*2y 08				
03Y	61 / 61.5 / 61.75 / 62		2*3y 5.5				
04Y	65.75 / 66		2*7y 18				
05Y	68.5 / 69 / 69.25		3*5y 07				
07Y	73.75		3*7y 12.5				
10Y	81.5		4*5y 3.25				
12Y			5*10y 12.5 / 12.75 / 13				
15Y			5*15y 15.75				
20Y							
CRS							
TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	88건 (-12건)	KTB	109.40	-0.04	109.46	109.47	109.39
금 액	21,894억원 (+2,945억원)	LKTB	125.45	0.06	125.60	125.60	125.31

장중동향

금일 채권시장은 미국채에 연동하며 강보합으로 시작, 국내외 재료부재로 혼조세. 국고채 단순매입이 10년물 중심이어서 상대적으로 단기에 비해 장기가 강한 모습을 보이며 장단기 금리가 엇갈림.

IRS는 기본적으로 비드가 우위인 상태에서 오퍼가 나와 거래. 어제이 이어 단기부터 3년정도까지 비디시한 가운데 오퍼도 활발하게 호가형성. 장기와 초장기는 현물이 매수우위를 보임에 따라 커브 플랫. 2*7y, 3*7y, 5*10y등 스플거래도 활발.

CRS는 거래가 많지않은가운데 월말 자금수요로 오퍼우위를 보이며 전체적으로 레벨 하락 마감.

ETC

■통안2y(통당) 2.4조 입찰 ★낙찰금리 1.36%

■ 국고 7,000억 단순매입

* 대상증권

국고 11-7 (만기 2031.12.10)

국고 15-2 (만기 2025.06.10)

국고 14-5 (만기 2024.09.10)

국고 13-6 (만기 2023.09.10)

국고 15-1 (만기 2020.03.10)