IPS Daily Closing Brief

2017-06-09

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	1.3950	0.00	1.3925	1.3993	1.4350	1.6550	1.2875	2.7950	1.2875
9M	1.4150	0.00	1.4125	1.4225	1.4546	1.6200	1.2500	2.7900	1.2500
1Y	1.4375	-0.25	1.4370	1.4486	1.4742	1.6075	1.2200	2.8150	1.2200
1.5Y	1.4775	0.00	1.4740	1.4904	1.5135	1.6125	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5100	0.00	1.5065	1.5271	1.5486	1.6475	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.5700	0.25	1.5660	1.5969	1.6153	1.7200	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6175	0.00	1.6180	1.6514	1.6692	1.7825	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.6600	0.00	1.6620	1.7010	1.7184	1.8400	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7300	0.00	1.7325	1.7738	1.7942	1.9225	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8250	0.25	1.8275	1.8761	1.8940	2.0250	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.8625	0.25	1.8650	1.9129	1.9316	2.0650	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.8700	0.25	1.8730	1.9204	1.9354	2.0575	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.8775	0.50	1.8785	1.9248	1.9270	2.0550	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	2.00	0.00	2.00	2.33	1.96	3.25	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	2.25	-0.25	2.45	2.61	1.96	3.25	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	7.25	0.25	6.95	7.85	7.45	9.75	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	6.00	0.25	5.95	6.98	6.67	8.50	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	10.75	0.00	11.15	12.43	12.05	15.25	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	15.00	0.00	15.55	17.39	16.98	21.00	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	4.75	-0.25	5.20	5.45	5.39	7.75	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.00	-0.25	9.60	10.41	10.31	14.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.00	4.40	4.96	4.93	6.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.00	0.00	7.05	7.28	7.58	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	16.50	0.25	16.55	17.51	17.56	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.50	0.25	9.50	10.24	9.98	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	4.55	4.43	4.13	8.00	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	5.25	0.25	5.10	4.86	3.30	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	1.4250	-0.50	1Y	1.25	0.25	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5300	-0.50	1.5Y	-5.25	0.50	-0.10	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.5870	-0.30	2Y	-7.70	0.30	-1.35	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6300	-0.50	3Y	-6.00	0.75	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.7750	-0.70	4Y	-15.75	0.70	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8470	-0.80	5Y	-18.70	0.80	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0440	-0.30	7Y	-31.40	0.30	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.1700	-0.20	10Y	-34.50	0.45	-12.95	-38.70	6.00	-38.70

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1123.20	(+1.10)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-59.75	2.25	0.8400	2.00	1.4000	0.7650	1*2Y	13.00	0.50
1.5Y	-58.25	2.00	0.8950	2.00	1.2850	0.8100	2*3Y	9.00	0.00
2Y	-54.00	2.50	0.9700	2.50	1.2250	0.7950	2*5Y	18.50	1.50
3Y	-51.00	2.25	1.0600	2.50	1.3150	0.7350	3*4Y	6.50	0.50
4Y	-49.25	3.00	1.1250	3.00	1.3750	0.6900	3*5Y	9.50	1.50
5Y	-50.50	4.00	1.1550	4.00	1.4350	0.6600	4*5Y	3.00	1.00
7Y	-55.00	4.00	1.1800	4.00	1.4500	0.6550	5*7Y	2.50	0.00
10Y	-53.00	3.75	1.2950	4.00	1.9050	0.6300	5*10Y	14.00	0.00

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	43.75		
1.5Y			
02Y	50.75 / 51	SPRD	1*2Y 07
03Y	56.5 / 57.25		3*7Y 16.25 / 16.5
04Y			
05Y	65.75		
07Y			
10Y	81.5 / 82.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	52건 (+8건)	KTB	109.66	0.02	109.67	109.68	109.64
금 액	11,831억원 (-3,504원)	LKTB	125.46	-0.01	125.58	125.59	125.41

장중동향

채권시장, 대형 해외 이벤트가 해소된 상황에서 시장은 크게 반응이 없는 분위기. 국채선물은 보합권 혼조세 마감. 영국 총선 결과에 따라서 소폭 움직였지만, FOMC를 앞둔 부담에 제한적인 움직임을 보임.

IRS, 특이 재료 없이 채권 금리를 추종하면서 전일 종가 대비 보합권에서 마감.
테너 전반에서 비디쉬한 장세 연출. 아웃라잇과 스프레드 모두 다양한 구간에서 비드 수요가 있었지만 거래는 많이 되지 않았음. 국채선물을 따라 조금씩 거래되는 정도.
그나마 1-3Y 구간 위주로 호가가 대치되는 편이었으며, 1*2Y 07(0.00), 2Y 50.75~51(-0.25~0.00)에서 거래.
3Y은 CCP 마감을 얼마 남기지 않은 시간에도 거래가 있었던 것으로 보임.

CRS, 부채스왑 가능성 등으로 이틀째 레벨 반등하며 마감. 커브 스티프닝.
거래는 한산했으며 GS칼텍스 부채스왑 물량에 대한 부담감이 있는 것으로 추정.
매일 보이던 에셋스왑 물량도 오늘은 잘 보이지 않아 오퍼보다 비드가 우세한 모습.

ETC