IPS Daily Closing Brief

2017-03-28

IRS				91d CD	1.47	(0.00)	CALL	1.23	(+0.01)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4875	0.75	1.4865	1.4985	1.4914	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875
9M	1.4975	0.75	1.4965	1.5104	1.4941	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500
1Y	1.5150	1.50	1.5080	1.5236	1.5002	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200
1.5Y	1.5450	1.50	1.5405	1.5599	1.5244	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5725	1.50	1.5695	1.5963	1.5495	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6325	1.25	1.6315	1.6629	1.6072	1.7925	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6825	1.25	1.6825	1.7209	1.6649	1.8700	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7250	1.00	1.7305	1.7733	1.7181	1.9375	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7925	0.75	1.7985	1.8519	1.7954	2.0325	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8925	0.75	1.8980	1.9514	1.8975	2.1400	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9275	0.75	1.9330	1.9869	1.9284	2.1975	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9275	0.75	1.9330	1.9844	1.9227	2.2300	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9125	0.75	1.9120	1.9484	1.8668	2.2675	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	1.00	0.00	1.00	1.19	0.27	2.50	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	1.75	0.75	1.15	1.33	0.61	2.50	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	5.75	0.00	6.15	7.26	4.93	9.50	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	6.00	-0.25	6.20	6.66	5.78	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	11.00	-0.25	11.30	12.46	11.54	16.75	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	15.25	-0.50	16.10	17.70	16.86	23.75	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	5.10	5.80	5.77	9.00	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.25	-0.25	9.90	11.04	11.09	16.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	-0.25	4.80	5.24	5.32	7.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.75	-0.25	6.80	7.86	7.73	10.00	0.25	16.25	0.25
5*10Y	16.75	-0.25	16.75	17.81	17.95	23.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	10.00	0.00	9.95	9.95	10.21	13.25	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.00	3.50	3.55	3.08	6.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.50	3.30	2.51	9.25	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	2.00	0.00	1.40	-0.30	-3.08	13.00	-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	1.4840	-0.30	1Y	3.10	1.80	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5490	0.20	1.5Y	-0.40	1.30	-0.20	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.6070	0.20	2Y	-3.45	1.30	-1.95	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6600	1.00	3Y	-2.75	0.25	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.7870	0.70	4Y	-10.45	0.55	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8550	1.00	5Y	-13.00	0.00	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0650	1.00	7Y	-27.25	-0.25	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.1650	1.30	10Y	-27.25	-0.55	-12.95	-37.25	6.00	-37.25

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1113.00	(+0.20)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-64.50	1.50	0.8700	3.00	1.4000	0.7650	1*2Y	16.00	0.50
1.5Y	-60.50	1.50	0.9400	3.00	1.2850	0.8100	2*3Y	11.50	0.50
2Y	-54.25	2.00	1.0300	3.50	1.2600	0.7950	2*5Y	28.00	0.50
3Y	-48.75	2.75	1.1450	4.00	1.3550	0.7350	3*4Y	9.50	0.00
4Y	-44.25	2.75	1.2400	4.00	1.4050	0.6900	3*5Y	16.50	0.00
5Y	-41.50	3.00	1.3100	4.00	1.4500	0.6600	4*5Y	7.00	0.00
7Y	-45.75	3.25	1.3350	4.00	1.4900	0.6550	5*7Y	2.50	0.00
10Y	-47.25	2.25	1.4200	3.00	1.9050	0.6300	5*10Y	11.00	-1.00

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	56.25	SPRD	1*2Y 5.5
03Y	62 / 62.25 / 63.25		1*5Y 20.75
04Y	66.5 / 67.25 / 67.5		2*5Y 15.25
05Y	71.5		3*4Y 05
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	108건 (+49건)	KTB	109.47	-5.00	109.50	109.54	109.47
금 액	26,420억원 (+14,557억원)	LKTB	125.13	-12.00	125.15	125.35	125.08

장중동향

국채선물은 장초반 외인의 매도세로 하락출발했으나 장중 매수전환으로 반등했다가 개장가 수준으로 마감.

IRS는 어제에 이어 전반적으로 오퍼리시한 모습이었고, 역외의 스프레드 오퍼로 커브가플래트닝되며 마감.

CRS는 비디가 올라오며 전테너 상승 마감.

ETC

<채권-마감> 금리 소폭 반등...초장기물 수급 부담
http://news.einfomax.co.kr/news/articleView.html?idxno=319737

<채권-마감> 금리 소폭 반등...초장기물 수급 부담
http://news.einfomax.co.kr/news/articleView.html?idxno=319735