IPS Daily Brief

2017-03-29

IRS				91d CD	1.45	(-0.02)	CALL	1.22	(-0.01)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4600	-2.25	1.4810	1.4968	1.4907	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875
9M	1.4750	-2.25	1.4920	1.5093	1.4938	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500
1Y	1.4925	-2.25	1.5050	1.5229	1.5001	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200
1.5Y	1.5250	-2.00	1.5375	1.5593	1.5246	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5575	-1.50	1.5675	1.5958	1.5501	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6200	-1.25	1.6300	1.6628	1.6082	1.7925	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6725	-1.00	1.6815	1.7209	1.6658	1.8700	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7150	-1.00	1.7275	1.7729	1.7188	1.9375	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7875	-0.50	1.7965	1.8514	1.7963	2.0325	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8900	-0.25	1.8980	1.9510	1.8985	2.1400	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9250	-0.25	1.9330	1.9865	1.9295	2.1975	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9250	-0.25	1.9330	1.9843	1.9239	2.2300	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9175	0.50	1.9155	1.9496	1.8698	2.2675	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	1.50	0.50	1.10	1.25	0.30	2.50	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	1.75	0.00	1.30	1.36	0.63	2.50	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	6.50	0.75	6.25	7.29	5.00	9.50	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	6.25	0.25	6.25	6.70	5.80	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	11.50	0.50	11.40	12.51	11.56	16.75	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	15.75	0.50	16.00	17.71	16.87	23.75	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	0.25	5.15	5.81	5.76	9.00	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.50	0.25	9.75	11.01	11.06	16.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.25	0.00	4.60	5.20	5.30	7.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.25	0.50	6.90	7.85	7.75	10.00	0.25	16.25	0.25
5*10Y	17.50	0.75	17.05	17.81	17.97	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	10.25	0.25	10.15	9.96	10.22	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	3.50	0.00	3.50	3.55	3.10	6.50	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.50	3.33	2.54	9.25	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	2.75	0.75	1.75	-0.14	-2.88	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	1.4790	-0.50	1Y	1.35	-1.75	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5400	-0.90	1.5Y	-1.50	-1.10	-0.20	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.6000	-0.70	2Y	-4.25	-0.80	-1.95	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6560	-0.40	3Y	-3.60	-0.85	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.7800	-0.70	4Y	-10.75	-0.30	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8450	-1.00	5Y	-13.00	0.00	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0590	-0.60	7Y	-27.15	0.10	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.1620	-0.30	10Y	-27.20	0.05	-12.95	-37.25	6.00	-37.25

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1114.20	(+1.20)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-58.75	5.75	0.9050	3.50	1.4000	0.7650	1*2Y	15.50	-0.50
1.5Y	-55.50	5.00	0.9700	3.00	1.2850	0.8100	2*3Y	11.50	0.00
2Y	-49.75	4.50	1.0600	3.00	1.2600	0.7950	2*5Y	27.00	-1.00
3Y	-44.50	4.25	1.1750	3.00	1.3550	0.7350	3*4Y	9.00	-0.50
4Y	-40.75	3.50	1.2650	2.50	1.4050	0.6900	3*5Y	15.50	-1.00
5Y	-38.50	3.00	1.3300	2.00	1.4500	0.6600	4*5Y	6.50	-0.50
7Y	-43.25	2.50	1.3550	2.00	1.4900	0.6550	5*7Y	2.50	0.00
10Y	-44.50	2.75	1.4450	2.50	1.9050	0.6300	5*10Y	11.50	0.50

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M	46.75	ODD Tenor	8Y 83 / 83.5
09M	48.25		
01Y	49.5 / 49.75 / 50		
1.5Y			
02Y	56.75 / 57	SPRD	9*12M 1.75
03Y	63		2*3Y 06
04Y	67.25 / 68 / 68.25		4*5Y 4.25
05Y			4*8Y 15 / 15.25
07Y	78.75 / 79.25		5*10Y 17
10Y			10*20Y 2.5
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3Y 17		

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	78 (전일대비 -30건)	KTB	109.50	3.00	109.44	109.52	109.44
금 액	21580 (전일대비 -4,840억원)	LKTB	125.15	2.00	124.95	125.22	124.93

장중동향

전일 미국 금리가 반등하면서 국내시장도 밀리면서 출발했으나, 우리나라는 특별한 재료 없이 외국인의 3년과 10년 윈도드레싱성 국채선물 순매수가 늘어나면서 장을 받치는 형세. 월말 경제지표 발표를 앞두고 소극적으로 대응하는 영향도 있는 듯.

IRS는 CD가 언더로 발행되면서 단기물 위주로 금리 하락.
장기물은 스프레드로 비드가 많았음. 커브 스팁.

CRS 금리는 급락했던 FX스왑 되돌림 속에 부채스왑 물량 유입으로 전일에 이어서 단기구간 중심 레벨 상승. 3~4년 구간으로 비드가 꾸준.

ETC

***신한은행CD 3개월 1.45% (언더 2) 발행 (만기일 6월 29일)**

[유럽 경제지표 및 연설일정]

1730 英 2월 민간대출
1730 英 2월 BOE 실질금리
N/A 英 테리사 메이 영국 총리 브렉시트 공식선언

[미국경제지표 및 연설일정]

2000 美 03/24 모기지은행협회(MBA) 주간 모기지 신청건수
2130 美 Q4 국제투자대조표
2220 찰스 에번스 시카고 연은 총재 연설
2300 美 2월 잠정주택판매
2330 美 03/24 에너지정보청(EIA) 주간 원유재고
0030(목) 美 에릭 로젠그렌 보스턴 연은 총재 연설
0215(목) 존 윌리엄스 샌프란시스코 연은 총재 연설