

IPS Daily Closing Brief

2017-04-04

IRS			91d CD			1.45	(0.00)	CALL	1.25	(-0.02)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.4500	-0.75	1.4570	1.4865	1.4889	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875	
9M	1.4625	-0.75	1.4705	1.4993	1.4934	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500	
1Y	1.4725	-1.00	1.4845	1.5125	1.5006	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200	
1.5Y	1.5050	-1.50	1.5195	1.5483	1.5266	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5350	-1.75	1.5520	1.5834	1.5540	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6000	-2.50	1.6200	1.6518	1.6136	1.7925	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6525	-2.75	1.6745	1.7093	1.6708	1.8700	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.7000	-3.00	1.7225	1.7601	1.7236	1.9375	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.8050	0.25	1.8035	1.8390	1.8024	2.0325	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8875	-1.50	1.8990	1.9373	1.9039	2.1400	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.9075	-3.00	1.9310	1.9718	1.9351	2.1975	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9100	-3.00	1.9330	1.9713	1.9303	2.2300	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.9050	-3.50	1.9305	1.9439	1.8829	2.2675	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	1.25	0.00	1.35	1.28	0.45	2.50	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	1.00	-0.25	1.40	1.33	0.72	2.50	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	6.25	-0.75	6.75	7.09	5.34	9.50	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	6.50	-0.75	6.80	6.84	5.96	9.00	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	11.75	-1.00	12.25	12.59	11.68	16.75	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	16.50	-1.25	17.05	17.68	16.96	23.75	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.25	-0.25	5.45	5.75	5.71	9.00	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	10.00	-0.50	10.25	10.84	11.00	16.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	4.75	-0.25	4.80	5.09	5.28	7.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	10.50	3.25	8.10	7.89	7.88	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	18.75	1.50	17.65	17.71	18.03	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	8.25	-1.75	9.55	9.83	10.15	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	2.00	-1.50	3.20	3.45	3.13	6.00	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	2.25	-1.50	3.40	3.40	2.65	9.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	1.75	-2.00	3.15	0.66	-2.10	13.00	-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	1.4510	-0.90	1Y	2.15	-0.10	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5180	-0.40	1.5Y	-1.30	-1.10	-0.20	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.5820	-0.80	2Y	-4.70	-0.95	-1.95	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6470	-1.00	3Y	-4.70	-1.50	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.7550	-1.00	4Y	-10.25	-1.75	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8050	-2.10	5Y	-10.50	-0.90	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0240	-3.00	7Y	-21.90	3.25	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.1300	-3.70	10Y	-24.25	2.20	-12.95	-37.25	6.00	-37.25	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1121.90	(+6.60)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-56.25	0.00	0.9100	-1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	17.00	-0.50	
1.5Y	-53.00	0.00	0.9750	-1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	13.50	0.00	
2Y	-45.50	0.25	1.0800	-1.50	1.2600	0.7950	2*5Y	28.00	-1.00	
3Y	-38.50	1.00	1.2150	-1.50	1.3550	0.7350	3*4Y	8.00	-0.50	
4Y	-35.75	0.75	1.2950	-2.00	1.4050	0.6900	3*5Y	14.50	-1.00	
5Y	-34.00	0.50	1.3600	-2.50	1.4500	0.6600	4*5Y	6.50	-0.50	
7Y	-42.50	-3.25	1.3800	-3.00	1.4900	0.6550	5*7Y	2.00	-0.50	
10Y	-40.25	-1.50	1.4850	-3.00	1.9050	0.6300	5*10Y	12.50	-0.50	

TODAY DEAL LEVEL								
IRS	Lv.		ODD Tenor					
06M	45							
09M	4625							
01Y	47.5							
1.5Y	50.5							
02Y	53.5		SPRD	1*2Y	5.75 / 06			
03Y	60.25			3*5Y	10			
04Y				3*7Y	16.75			
05Y	70			10*20Y	04			
07Y								
10Y	86.5 / 81.25							
12Y								
15Y								
20Y	90.5							
CRS	1.5Y@97.5, 3Y@21.5, 4Y@29.5							
TODAY KRX CCP			국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황			KTB	109.54	5.00	109.55	109.59	109.53
금 액			LKTB	125.45	35.00	125.30	125.51	125.30

장중동향

미국의 제조업 지표가 혼조세를 보인가운데 외국인의 채권매수세가 돋보이며 갭업 출발한 국채선물은 종일 강세. 30년 물 입찰이 호조를 보인데 따라 장기물 수급 불안감이 완화되며 금리는 하락 마감.

IRS는 오전 거래가 다소 적은가운데 2년과 3년쪽으로 거래가 몰리는모습. 중장기로 갈수록 오퍼리시해지며 커브가 플랫트닝되었고, 30년물 입찰 후 장기쪽 강세폭이 커짐. 오후들어 전테너 활발히 거래되었고, 특히 10*20y 04에 거래되며 장기 스프레드 활발한 모습.

CRS는 최근 상승한 레벨이 일부 되돌려지며 하락 커브는 플랫트닝.

ETC

[금일 입찰 결과]

국고 30년 1.55조 입찰 [10:40~11:00] ★2.325% 낙찰

호주중앙은행, 기준금리 1.50%로 동결