# IPS Daily Closing Brief

**2017-04-05**

| IRS | | | | 91d CD | 1.45 | ( 0.00) | CALL | 1.25 | ( 0.00) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Tenor | Lv. | 전일비 | 5MA | 20MA | 60MA | 1Y Max | 1Y Min | 3Y Max | 3Y Min |
| 6M | 1.4500 | 0.00 | 1.4550 | 1.4834 | 1.4884 | 1.6725 | 1.2875 | 2.8575 | 1.2875 |
| 9M | 1.4625 | 0.00 | 1.4680 | 1.4959 | 1.4932 | 1.6850 | 1.2500 | 2.8300 | 1.2500 |
| 1Y | 1.4725 | 0.00 | 1.4805 | 1.5088 | 1.5006 | 1.6925 | 1.2200 | 2.8200 | 1.2200 |
| 1.5Y | 1.5075 | 0.25 | 1.5160 | 1.5441 | 1.5270 | 1.7125 | 1.1900 | 2.8725 | 1.1900 |
| 2Y | 1.5375 | 0.25 | 1.5480 | 1.5785 | 1.5547 | 1.7300 | 1.1675 | 2.9350 | 1.1675 |
| 3Y | 1.6000 | 0.00 | 1.6160 | 1.6464 | 1.6144 | 1.7925 | 1.1550 | 3.0650 | 1.1550 |
| 4Y | 1.6550 | 0.25 | 1.6710 | 1.7036 | 1.6714 | 1.8700 | 1.1575 | 3.1875 | 1.1575 |
| 5Y | 1.7025 | 0.25 | 1.7200 | 1.7543 | 1.7241 | 1.9375 | 1.1575 | 3.3050 | 1.1575 |
| 7Y | 1.7725 | -3.25 | 1.8005 | 1.8326 | 1.8029 | 2.0325 | 1.1675 | 3.4625 | 1.1675 |
| 10Y | 1.8725 | -1.50 | 1.8955 | 1.9310 | 1.9042 | 2.1400 | 1.2125 | 3.6250 | 1.2125 |
| 12Y | 1.9150 | 0.75 | 1.9290 | 1.9656 | 1.9357 | 2.1975 | 1.2150 | 3.6575 | 1.2150 |
| 15Y | 1.9150 | 0.50 | 1.9310 | 1.9651 | 1.9310 | 2.2300 | 1.2150 | 3.6675 | 1.2150 |
| 20Y | 1.9075 | 0.25 | 1.9285 | 1.9404 | 1.8846 | 2.2675 | 1.2150 | 3.8075 | 1.2150 |
| 6*9M | 1.25 | 0.00 | 1.30 | 1.25 | 0.48 | 2.50 | -6.00 | 4.25 | -6.50 |
| 9*12M | 1.00 | 0.00 | 1.25 | 1.29 | 0.74 | 2.50 | -4.00 | 4.50 | -5.75 |
| 1*2Y | 6.50 | 0.25 | 6.75 | 6.98 | 5.40 | 9.50 | -5.50 | 16.25 | -8.75 |
| 2*3Y | 6.25 | -0.25 | 6.80 | 6.79 | 5.98 | 9.00 | -1.75 | 15.00 | -1.75 |
| 2*4Y | 11.75 | 0.00 | 12.30 | 12.51 | 11.67 | 16.75 | -1.75 | 28.25 | -1.75 |
| 2*5Y | 16.50 | 0.00 | 17.20 | 17.58 | 16.94 | 23.75 | -1.75 | 39.25 | -1.75 |
| 3*4Y | 5.50 | 0.25 | 5.50 | 5.73 | 5.70 | 9.00 | -0.50 | 14.00 | -0.50 |
| 3*5Y | 10.25 | 0.25 | 10.40 | 10.79 | 10.97 | 16.00 | -0.50 | 25.00 | -0.50 |
| 4*5Y | 4.75 | 0.00 | 4.90 | 5.06 | 5.27 | 7.25 | -0.25 | 11.75 | -0.25 |
| 5*7Y | 7.00 | -3.50 | 8.05 | 7.84 | 7.88 | 10.50 | 0.25 | 16.25 | 0.25 |
| 5*10Y | 17.00 | -1.75 | 17.55 | 17.68 | 18.01 | 22.25 | 3.75 | 32.25 | 3.75 |
| 7*10Y | 10.00 | 1.75 | 9.50 | 9.84 | 10.13 | 12.75 | 3.00 | 16.75 | 3.00 |
| 10*12Y | 4.25 | 2.25 | 3.35 | 3.46 | 3.15 | 6.00 | -0.25 | 7.75 | -0.25 |
| 10*15Y | 4.25 | 2.00 | 3.55 | 3.41 | 2.69 | 9.25 | -0.75 | 15.00 | -0.75 |
| 10*20Y | 3.50 | 1.75 | 3.30 | 0.94 | -1.96 | 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 | 1.4470 | -0.40 | 1Y | 2.55 | 0.40 | 5.75 | -17.75 | 13.00 | -17.75 |
| 1.5Y | 1.5280 | 1.00 | 1.5Y | -2.05 | -0.75 | -0.20 | -19.10 | 9.75 | -19.10 |
| 2Y | 1.5900 | 0.80 | 2Y | -5.25 | -0.55 | -1.95 | -25.15 | 9.50 | -25.15 |
| 3Y | 1.6500 | 0.30 | 3Y | -5.00 | -0.30 | 4.75 | -19.50 | 11.00 | -19.50 |
| 4Y | 1.7670 | 1.20 | 4Y | -11.20 | -0.95 | -3.20 | -30.35 | 5.75 | -30.35 |
| 5Y | 1.8200 | 1.50 | 5Y | -11.75 | -1.25 | -2.25 | -27.25 | 8.50 | -27.25 |
| 7Y | 2.0320 | 0.80 | 7Y | -25.95 | -4.05 | -7.50 | -37.65 | 2.00 | -37.65 |
| 10Y | 2.1320 | 0.20 | 10Y | -25.95 | -1.70 | -12.95 | -37.25 | 6.00 | -37.25 |

| BASIS SWAP | | | CRS | | | | USD/KRW | 1124.40 | (+2.50) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Tenor | Lv. | 전일비 | Lv. | 전일비 | 1Y Max | 1Y Min | SPRD | Lv. | 전일비 |
| 1Y | -55.75 | 0.50 | 0.9150 | 0.50 | 1.4000 | 0.7650 | 1*2Y | 18.00 | 1.00 |
| 1.5Y | -52.25 | 0.75 | 0.9850 | 1.00 | 1.2850 | 0.8100 | 2*3Y | 15.00 | 1.50 |
| 2Y | -44.25 | 1.25 | 1.0950 | 1.50 | 1.2600 | 0.7950 | 2*5Y | 27.50 | -0.50 |
| 3Y | -35.50 | 3.00 | 1.2450 | 3.00 | 1.3550 | 0.7350 | 3*4Y | 7.50 | -0.50 |
| 4Y | -33.50 | 2.25 | 1.3200 | 2.50 | 1.4050 | 0.6900 | 3*5Y | 12.50 | -2.00 |
| 5Y | -33.25 | 0.75 | 1.3700 | 1.00 | 1.4500 | 0.6600 | 4*5Y | 5.00 | -1.50 |
| 7Y | -37.25 | 5.25 | 1.4000 | 2.00 | 1.4900 | 0.6550 | 5*7Y | 3.00 | 1.00 |
| 10Y | -36.75 | 3.50 | 1.5050 | 2.00 | 1.9050 | 0.6300 | 5*10Y | 13.50 | 1.00 |

## TODAY DEAL LEVEL

| IRS | Lv. | | |
|---|---|---|---|
| 06M | | ODD Tenor | |
| 09M | | | |
| 01Y | 47.25 / 47.5 | | |
| 1.5Y | | | |
| 02Y | 53.75 | SPRD | 1*3Y 12.75 |
| 03Y | 60 / 60.25 / 60.5 | | 2*3Y 6.5 |
| 04Y | | | 4*5Y 4.75 |
| 05Y | 70.375 / 70.5 | | 10*20Y 3.5 |
| 07Y | 77 | | |
| 10Y | 86.75 / 87 | | |
| 12Y | | | |
| 15Y | | | |
| 20Y | 91 | | |
| CRS | 2Y 22<br>5Y 36 | | |

| TODAY KRX CCP | | 국채선물 | Lv. | 전일비 | 시 | 고 | 저 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 거래현황 | 86건 (+8건) | KTB | 109.52 | -2.00 | 109.52 | 109.55 | 109.50 |
| 금 액 | 16,070억원 (-1,390억원) | LKTB | 125.46 | 1.00 | 125.37 | 125.47 | 125.27 |

## 장중동향

국내 채권금리, 미 국채 금리 상승에 약보합세로 출발. 통안채 2년물 경쟁입찰 물량 부담이 영향을 미쳐 장기물보다 단기물 금리가 상대적으로 크게 상승. 하지만 미 3월 FOMC 회의록 공개와 미·중 정상회담을 앞두고 관망세가 이어진 탓에 금리는 큰 변동성 없이 약보합권에서 등락하다 마감.

IRS, 채권 흐름에 영향을 받으면서 연동되는 모습.
오전 1y~3y 호가 활발. 특히 3년이 활발했는데, 마켓 60~60.5 레벨까지 거래. 오퍼 사이드가 좀 더 많아 비드가 나오면 기븐되는 경향. 어제에 이어 7년 관련 수요가 보이며, 7년, 10년, 20년 등 긴쪽 거래도 간간이 이어짐.
오후장, 채권 약보합 분위기에 영향을 받아 제한적인 금리 상승. 점심시간 이후 3~10y 구간 모두 비드를 찾으며 거래는 한산한 분위기를 유지하다 10선 등락에 따라 5년 아웃라잇 거래가 활발.

CRS, 전일 간만에 약간 하락했지만 최근 부채 영향을 계속 받았고 오늘은 다시 레벨이 상승해 마감.

## ETC

**[금일 입찰 결과]**
[10:00 ~ 10:10] 통안 2년물(0160-1904-0200)(통딱) 2.7조 입찰 ★1.60% 낙찰