IPS Daily Closing Brief

2017-04-06

IRS				91d CD	1.45	(0.00)	CALL	1.23	(-0.02)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4550	0.75	1.4545	1.4804	1.4880	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875
9M	1.4700	0.75	1.4675	1.4928	1.4932	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500
1Y	1.4850	1.25	1.4800	1.5055	1.5008	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200
1.5Y	1.5200	1.25	1.5155	1.5405	1.5275	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5600	2.25	1.5490	1.5746	1.5556	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6250	2.50	1.6165	1.6419	1.6153	1.7925	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6825	2.75	1.6715	1.6988	1.6722	1.8700	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7350	3.25	1.7210	1.7491	1.7248	1.9375	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8175	4.50	1.8020	1.8276	1.8036	2.0325	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9175	4.50	1.8985	1.9260	1.9048	2.1400	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9575	4.25	1.9330	1.9618	1.9365	2.1975	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9625	4.75	1.9355	1.9604	1.9320	2.2300	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9550	4.75	1.9315	1.9356	1.8866	2.2675	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	1.50	0.25	1.30	1.24	0.52	2.50	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	1.50	0.50	1.25	1.28	0.77	2.50	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	7.50	1.00	6.90	6.91	5.48	9.50	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	6.50	0.25	6.75	6.73	5.98	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.25	0.50	12.25	12.41	11.66	16.75	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.50	1.00	17.20	17.45	16.92	23.75	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	0.25	5.50	5.69	5.69	9.00	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.00	0.75	10.45	10.73	10.94	16.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.25	0.50	4.95	5.04	5.25	7.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	8.25	1.25	8.10	7.85	7.89	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	18.25	1.25	17.75	17.69	18.00	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	10.00	0.00	9.65	9.84	10.11	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.00	-0.25	3.45	3.58	3.18	6.00	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.25	3.70	3.44	2.73	9.25	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.75	0.25	3.30	0.96	-1.82	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	1.4480	0.10	1Y	3.70	1.15	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5280	0.00	1.5Y	-0.80	1.25	-0.20	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.5800	-1.00	2Y	-2.00	3.25	-1.95	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6750	2.50	3Y	-5.00	0.00	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.8020	3.50	4Y	-11.95	-0.75	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8700	5.00	5Y	-13.50	-1.75	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0830	5.10	7Y	-26.55	-0.60	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.1840	5.20	10Y	-26.65	-0.70	-12.95	-37.25	6.00	-37.25

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1133.20	(+8.80)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-59.50	-3.75	0.8900	-2.50	1.4000	0.7650	1*2Y	17.50	-0.50
1.5Y	-56.00	-3.75	0.9600	-2.50	1.2850	0.8100	2*3Y	14.50	-0.50
2Y	-49.50	-5.25	1.0650	-3.00	1.2600	0.7950	2*5Y	27.00	-0.50
3Y	-41.50	-6.00	1.2100	-3.50	1.3550	0.7350	3*4Y	7.50	0.00
4Y	-39.75	-6.25	1.2850	-3.50	1.4050	0.6900	3*5Y	12.50	0.00
5Y	-40.00	-6.75	1.3350	-3.50	1.4500	0.6600	4*5Y	5.00	0.00
7Y	-45.75	-8.50	1.3600	-4.00	1.4900	0.6550	5*7Y	2.50	-0.50
10Y	-45.25	-8.50	1.4650	-4.00	1.9050	0.6300	5*10Y	13.00	-0.50

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M	45	ODD Tenor	
09M	46		
01Y	47 / 47.25 / 47.25		
1.5Y	50.5 / 51.5		
02Y	54.75	SPRD	1.5*2Y 3.25
03Y	59.5 / 60.5		1*3Y 14
04Y			3*7y 17.25
05Y	69.75 / 70.5 / 71		
07Y			
10Y	76.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	117건 (+31건)	KTB	109.39	-13.00	109.54	109.55	109.35
금 액	27,710억원 (+11,640억원)	LKTB	124.92	-54.00	125.47	125.58	124.82

장중동향

채권선물은 별다른 재료없이 보합권에서 움직이다가 오후에 외국인의 대량매도로 큰폭으로 하락 마감. 10년선물은 반빅이상 하락.

IRS는 최근 계속되는 아웃라잇 오퍼우위 분위기속에 여전히 비드가 나오면 거래가 이루어지는 모습. 현선물 움직임과 크게 연동되지 않고 버티던 스왑 레벨은 장 후반 선물이 급락하면서 크게 상승했고 커브도 스티프닝 마감.

라이어물량으로 상승했던 CRS 레벨은 에셋프라이싱과 미사일 도발로 인한 지정학적 리스크가 부각되며 오퍼우위를 보이며 하락마감.

ETC

★4월 6일 Market Point★

한은 임시국회 민생경제 특위 현안보고 [10:00~]
中 3월 차이신 서비스업 PMI(예 53.2,전 52.6)[10:45]
KDI 4월 경제동향[12:00]
드라기 ECB총재 연설[16:00]
ECB 3월 통화정책회의 의사록[20:30]