IPS Daily Closing Brief

2017-04-10

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	1.4525	0.25	1.4515	1.4749	1.4871	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875
9M	1.4675	0.25	1.4655	1.4871	1.4929	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500
1Y	1.4825	0.25	1.4785	1.4998	1.5009	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200
1.5Y	1.5250	1.00	1.5145	1.5349	1.5286	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5625	1.50	1.5485	1.5684	1.5575	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6275	1.75	1.6125	1.6340	1.6176	1.7925	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6850	2.00	1.6680	1.6895	1.6745	1.8700	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7400	2.25	1.7190	1.7395	1.7269	1.9375	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.8275	2.25	1.8055	1.8180	1.8061	2.0325	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.9300	3.00	1.9015	1.9155	1.9073	2.1400	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9700	3.00	1.9380	1.9515	1.9394	2.1975	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9750	3.00	1.9415	1.9514	1.9354	2.2300	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9650	3.00	1.9335	1.9306	1.8920	2.2675	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	1.50	0.00	1.40	1.23	0.58	2.50	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	1.50	0.00	1.30	1.26	0.80	2.50	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	8.00	1.25	7.00	6.86	5.66	9.50	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	6.50	0.25	6.40	6.56	6.01	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	12.25	0.50	11.95	12.11	11.70	16.75	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	17.75	0.75	17.05	17.11	16.94	23.75	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.75	0.25	5.55	5.55	5.69	9.00	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	11.25	0.50	10.65	10.55	10.93	16.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	5.50	0.25	5.10	5.00	5.24	7.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	8.75	0.00	8.65	7.85	7.92	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	19.00	0.75	18.25	17.60	18.04	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	10.25	0.75	9.60	9.75	10.12	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	3.65	3.60	3.21	6.00	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.00	4.00	3.59	2.81	9.25	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	0.00	3.20	1.51	-1.53	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	1.4610	0.90	1Y	2.15	-0.65	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5540	1.90	1.5Y	-2.90	-0.90	-0.20	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.6400	3.00	2Y	-7.75	-1.50	-1.95	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.7190	3.90	3Y	-9.15	-2.15	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.8500	4.50	4Y	-16.50	-2.50	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.9270	4.70	5Y	-18.70	-2.45	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.1430	5.00	7Y	-31.55	-2.75	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.2490	5.20	10Y	-31.90	-2.20	-12.95	-37.25	6.00	-37.25

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1142.20	(+7.70)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-59.25	-2.25	0.8900	-2.00	1.4000	0.7650	1*2Y	15.50	0.50
1.5Y	-57.00	-2.50	0.9550	-1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	13.50	0.00
2Y	-51.75	-3.00	1.0450	-1.50	1.2600	0.7950	2*5Y	27.50	0.50
3Y	-44.75	-3.25	1.1800	-1.50	1.3550	0.7350	3*4Y	8.00	0.50
4Y	-42.50	-3.00	1.2600	-1.00	1.4050	0.6900	3*5Y	14.00	0.50
5Y	-42.00	-3.25	1.3200	-1.00	1.4500	0.6600	4*5Y	6.00	0.00
7Y	-47.75	-2.75	1.3500	-0.50	1.4900	0.6550	5*7Y	3.00	0.50
10Y	-47.50	-3.50	1.4550	-0.50	1.9050	0.6300	5*10Y	13.50	0.50

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.
06M	
09M	46.75
01Y	48.25
1.5Y	52.25
02Y	46 / 56.25
03Y	62.5 / 63
04Y	
05Y	73.5 / 73.75 / 74
07Y	82.5
10Y	92.5 / 92.75 / 93
12Y	
15Y	
20Y	

ODD Tenor	

SPRD	
9*12M	1.5
2*5Y	17.5
4*5Y	5.25
5*10Y	19

CRS

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	71건 (-18건)	KTB	109.24	-13.00	109.35	109.35	109.22
금 액	19,765억원 (+2,948억원)	LKTB	124.22	-51.00	124.62	124.63	124.10

장중동향

채권시장, 미국채 금리 상승과 더불어 여전히 한반도를 둘러싼 지정학적 리스크가 이어지면서 금리 상승폭 확대.
국고채 5년물 입찰은 시장 약세에도 무난하게 진행된 것으로 평가.
이번 주말 김일성 북한 주석의 생일인 태양절을 맞아 북한이 다시 도발할 수 있다는 우려에 시장 약세 지속.
외인이 국채선물 매도세를 3거래일째 이어가는 점도 부담으로 작용.

IRS는 채권시장 약세 흐름 영향을 받으며 커브 스티프닝.
지정학적 리스크로 현선물이 약세를 보이는 데 비해 IRS는 소폭 강한 수준을 보이며 장중 전테너 오퍼리쉬.
CD가 언더1에서 발행됐는데 별로 반영되지 않은 가운데 장기 위주로 금리가 상승하며 10y부터 3bp 상승.
거래가 그다지 많은 편은 아니었지만, 1.5y,3y,10y 위주로 호가 대치가 활발.

CRS, 3거래일 연속 하락 마감. 수급이 지난주에 꽤 해소되어 소강상태로 환율 상승을 반영하는 정도.

ETC

우리CD: 3개월 1.44(민-1) 2천억 마감
신한CD: 4개월 1.46(민-1) 마감

[금일 입찰]
국고 5년 입찰 1.95조[10:40~11:00] ★1.915% 낙찰
통안 1년 입찰 1.4조[10:00~10:10] ★1.49% 낙찰
통안 91일물 입찰 1.2조[13:30~13:40] ★1.30% 낙찰