IPS Daily Closing Brief

2017-04-11

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	44	ODD Tenor	
09M			
01Y	47.25		
1.5Y	52 / 52.25		
02Y	54.5 / 55.5	SPRD	1.5*2Y 03
03Y	59.75 / 62 / 62.25 / 62.5		2*5Y 15.75
04Y			4*7Y 13.5
05Y	70.25		10*15Y 4.5
07Y	81.75		
10Y	88 / 89 / 89.25 / 89.75 / 92.25		
12Y			
15Y			
20Y			
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

최근 3거래일간 한국시장은 환율과 주식, 채권이 모두 약세를 보이는 트리블약세가 나타나면서, 오늘역시 트리플약세와 안전자산선호 사이에서 대립구도를 보임. 채권은 하루종일 강세폭을 키우며 일중 최고점으로 마감.

IRS는 선물이 강보합으로 출발함에 따라 꾸준한 오퍼강세를 보였고, 채권이 강해짐에 따라 비드가 안보이는 가운데 3년 이상으로 비드가 나오면 기븐되며 거래가 형성. 단기쪽은 비드가, 장기쪽으로 갈수록 오퍼가 강했음.

CRS는 3년,4년 쪽으로 라이어빌리티 영향으로 비드가 나온것을 제외하고는 장기구간 위주로 하락마감.

ETC

우리은행채: 3년물 1.95%(민+5.3) 8,800억 마감

<채권-마감> 금리 하락...외국인 매수 유입에 숏커버
http://news.einfomax.co.kr/news/articleView.html?idxno=324435

IRS 금리 하락...외국인 국채선물 매수에 오퍼 유입
http://news.einfomax.co.kr/news/articleView.html?idxno=324430