

IPS Daily Closing Brief

2017-04-14

IRS			91d CD			1.42	(-0.01)	CALL	1.23	(0.00)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.4275	0.25	1.4350	1.4616	1.4839	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875	
9M	1.4450	0.25	1.4520	1.4749	1.4914	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500	
1Y	1.4600	0.75	1.4650	1.4875	1.5002	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200	
1.5Y	1.4950	0.75	1.5030	1.5229	1.5300	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5275	0.75	1.5365	1.5553	1.5605	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.5925	1.00	1.5980	1.6189	1.6221	1.7925	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6425	0.75	1.6510	1.6724	1.6786	1.8700	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.6850	0.50	1.7010	1.7216	1.7304	1.9375	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7650	0.75	1.7835	1.7995	1.8102	2.0325	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8575	0.75	1.8790	1.8966	1.9115	2.1400	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.8975	0.75	1.9190	1.9333	1.9445	2.1975	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9025	0.75	1.9240	1.9355	1.9415	2.2300	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.8900	0.75	1.9130	1.9224	1.9020	2.2675	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	1.75	0.00	1.70	1.33	0.75	2.50	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	1.50	0.50	1.30	1.26	0.88	2.50	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	6.75	0.00	7.15	6.78	6.03	9.50	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	6.50	0.25	6.15	6.36	6.16	9.00	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	11.50	0.00	11.45	11.71	11.81	16.75	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	15.75	-0.25	16.45	16.64	17.00	23.75	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.00	-0.25	5.30	5.35	5.65	9.00	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	9.25	-0.50	10.30	10.28	10.83	16.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	4.25	-0.25	5.00	4.93	5.18	7.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	8.00	0.25	8.25	7.79	7.98	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	17.25	0.25	17.80	17.50	18.11	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	9.25	0.00	9.55	9.71	10.14	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.66	3.30	6.00	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.50	0.00	4.50	3.89	3.00	9.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	3.25	0.00	3.40	2.58	-0.96	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	1.4690	0.40	1Y	-0.90	0.35	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5420	0.00	1.5Y	-4.70	0.75	-0.20	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6000	0.30	2Y	-7.25	0.45	-1.95	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6750	0.30	3Y	-8.25	0.70	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.7870	0.20	4Y	-14.45	0.55	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8550	0.30	5Y	-17.00	0.20	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0760	0.60	7Y	-31.10	0.15	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.1830	0.80	10Y	-32.55	-0.05	-12.95	-37.25	6.00	-37.25	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1140.00	(+10.30)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-61.50	-1.75	0.8450	-1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	15.00	-0.50	
1.5Y	-57.50	-1.75	0.9200	-1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	12.50	0.00	
2Y	-53.25	-2.25	0.9950	-1.50	1.2600	0.7950	2*5Y	22.00	0.00	
3Y	-47.25	-2.50	1.1200	-1.50	1.3550	0.7350	3*4Y	6.00	0.00	
4Y	-46.25	-2.25	1.1800	-1.50	1.4050	0.6900	3*5Y	9.50	0.00	
5Y	-47.00	-2.00	1.2150	-1.50	1.4500	0.6600	4*5Y	3.50	0.00	
7Y	-52.00	-2.25	1.2450	-1.50	1.4900	0.6550	5*7Y	3.00	0.00	
10Y	-51.75	-2.25	1.3400	-1.50	1.9050	0.6300	5*10Y	12.50	0.00	

TODAY DEAL LEVEL							
IRS	Lv.	ODD Tenor					
06M							
09M	44.25						
01Y	45						
1.5Y							
02Y	51.5 / 52.75	SPRD	3*4Y 05				
03Y	58.25 / 59 / 59.25		3*5Y 9.25				
04Y	63.5 / 64						
05Y	68.5 / 68.75		1*3*5Y 04				
07Y			3*4*5Y 0.25				
10Y	84.5						
12Y							
15Y							
20Y							
CRS							
TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	83건 (-10건)	KTB	109.45	0.00	109.47	109.49	109.39
금 액	27,830억원 (+3,168억원)	LKTB	124.95	-6.00	125.07	125.16	124.80

장중동향

미국이 시리아 공습과 항공모함 한반도 인근 배치 등에 이어 전일에는 아프가니 스탄에 대형 폭탄을 투하하는 등 지정학적 리스크를 자극하는 행보를 지속.

금일 일부 언론에서 미국의 군사행동에 대비해 김정은 노동장 위원장이 북한 평양시민에게 퇴거령을 내렸다는 보도가 있었으나 사실 여부는 미확인. 오는 15일 김일성 주석의 생일 대규모 행사를 위해 열병식을 준비하는 일환으로 평양시 내를 통제하고 있다는 보도 및 한성렬 북한 외무성 부상이 14일 AP통신과의 단독 인터뷰에서 “미국이 도발을 선택한다면 우리는 전쟁을 하겠다”고 언급한 보도도 있었음

IRS, 장중 채권 움직임에 연동되며 비디쉬 한 장. 2y,3y,5y 위주로 거래가 활발.

신한CD가 1.42%(언더 1)에 발행되면서 오후 CD가 1bp 하락

CRS, 금리 하락. 부채스왑이 소강상태인 틈을 타 달러-원 환율 상승과 에셋스왑 영향이 다소 있었음.

ETC

신한은행 91d CD (만기 2017-07-14) 발행 1.42% (언더 1) 2000억원