

IPS Daily Closing Brief

2017-04-18

IRS			91d CD			1.42	(0.00)	CALL	1.23	(0.00)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.4225	-0.25	1.4260	1.4548	1.4819	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875	
9M	1.4400	-0.25	1.4435	1.4688	1.4900	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500	
1Y	1.4525	0.00	1.4555	1.4815	1.4991	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200	
1.5Y	1.4875	0.00	1.4915	1.5166	1.5294	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5200	0.00	1.5240	1.5488	1.5604	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.5800	0.00	1.5855	1.6121	1.6225	1.7925	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6250	0.00	1.6350	1.6646	1.6786	1.8700	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.6650	-0.25	1.6795	1.7129	1.7298	1.9375	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7425	-0.50	1.7590	1.7906	1.8094	2.0325	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8325	-0.25	1.8505	1.8869	1.9105	2.1400	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.8725	-0.25	1.8905	1.9238	1.9438	2.1975	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.8775	-0.25	1.8955	1.9265	1.9413	2.2300	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.8650	-0.25	1.8835	1.9154	1.9037	2.2675	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	1.75	0.00	1.75	1.40	0.81	2.50	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	1.25	0.25	1.20	1.28	0.91	2.50	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	6.75	0.00	6.85	6.73	6.13	9.50	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	6.00	0.00	6.15	6.34	6.21	9.00	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	10.50	0.00	11.10	11.59	11.82	16.75	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	14.50	-0.25	15.55	16.41	16.94	23.75	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	4.50	0.00	4.95	5.25	5.61	9.00	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	8.50	-0.25	9.40	10.08	10.73	16.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	4.00	-0.25	4.45	4.83	5.12	7.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	7.75	-0.25	7.95	7.78	7.96	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	16.75	0.00	17.10	17.40	18.07	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	9.00	0.25	9.15	9.63	10.10	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.69	3.34	6.00	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.50	0.00	4.50	3.96	3.09	9.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	3.25	0.00	3.30	2.85	-0.67	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	1.4750	0.60	1Y	-2.25	-0.60	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5470	0.50	1.5Y	-5.95	-0.50	-0.20	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6050	0.50	2Y	-8.50	-0.50	-1.95	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6750	0.50	3Y	-9.50	-0.50	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.7870	0.20	4Y	-16.20	-0.20	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8470	0.00	5Y	-18.20	-0.25	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0640	-0.30	7Y	-32.15	-0.20	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.1700	-0.50	10Y	-33.75	0.25	-12.95	-37.25	6.00	-37.25	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1142.40	(+4.70)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-58.75	3.50	0.8650	3.50	1.4000	0.7650	1*2Y	14.50	-0.50	
1.5Y	-55.25	3.00	0.9350	3.00	1.2850	0.8100	2*3Y	12.00	-1.00	
2Y	-51.00	3.00	1.0100	3.00	1.2600	0.7950	2*5Y	20.00	-2.00	
3Y	-45.00	2.00	1.1300	2.00	1.3550	0.7350	3*4Y	5.00	0.00	
4Y	-44.50	2.00	1.1800	2.00	1.4050	0.6900	3*5Y	8.00	-1.00	
5Y	-45.50	1.25	1.2100	1.00	1.4500	0.6600	4*5Y	3.00	-1.00	
7Y	-51.25	1.00	1.2300	0.50	1.4900	0.6550	5*7Y	2.00	-0.50	
10Y	-50.75	0.75	1.3250	0.50	1.9050	0.6300	5*10Y	11.50	-0.50	

TODAY DEAL LEVEL								
IRS	Lv.		ODD Tenor					
06M								
09M	44.5							
01Y	45.25							
1.5Y								
02Y	52 / 52.25		SPRD	2*3y	06			
03Y	57.75 / 58			3*10y	25.25			
04Y				4*7y	12			
05Y	66.5 / 66.75			4*10y	20.75			
07Y								
10Y	83.25 / 83.5							
12Y								
15Y								
20Y								
CRS								
TODAY KRX CCP			국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	85건 (+14건)		KTB	109.47	2.00	109.45	109.47	109.43
금 액	17,930억원 (+2,155억원)		LKTB	125.15	11.00	125.05	125.15	124.95

장중동향

지정학적 리스크가 완화되면서 미국금리가 상승했고, 그에따라 국내 채권도 채권자금 쏠림 현상 악화. 질은 관망세속에서 보험권에서 움직이던 채권 선물은 장후반 소폭 상승하며 강보합 마감.

IRS는 어제에 이어 역외 아웃라잇 오퍼물량과 증권사의 본드스왑 페이 물량이 만나면서 3년과 10년으로 거래가 집중. 3년 1.5775%~1.58%, 10년 1.8325%~1.835% 레인지에서 거래.

CRS는 3년과 5년 구간을 중심으로 비드가 올라오며 레벨 상승 마감.

ETC

<KDI 경제전망> 물가 2% 안착까지 통화정책 완화 유지해야
 <KDI 경제전망> 새정부 추경편성 신중해야
 <KDI 경제전망> 'LTV·DTI 규제 환원' 고려해야
 <KDI 경제전망> 원화 실질실효환율 4% 상승