

IPS Daily Closing Brief

2017-04-20

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	1.4250	0.25	1.4245	1.4484	1.4800	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875	
9M	1.4425	0.25	1.4420	1.4631	1.4889	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500	
1Y	1.4550	0.25	1.4545	1.4761	1.4984	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200	
1.5Y	1.4900	0.50	1.4890	1.5114	1.5295	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5200	0.50	1.5205	1.5436	1.5608	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.5700	0.00	1.5785	1.6064	1.6231	1.7925	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6125	0.00	1.6235	1.6580	1.6787	1.8700	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.6500	0.00	1.6635	1.7049	1.7295	1.9375	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7175	0.00	1.7380	1.7826	1.8085	2.0325	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8000	-0.50	1.8260	1.8780	1.9090	2.1400	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.8425	-0.50	1.8670	1.9156	1.9429	2.1975	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.8475	-0.50	1.8720	1.9189	1.9409	2.2300	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.8375	-0.25	1.8600	1.9091	1.9053	2.2675	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	1.75	0.00	1.75	1.48	0.89	2.50	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	1.25	0.00	1.25	1.30	0.95	2.50	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	6.50	0.25	6.60	6.75	6.24	9.50	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	5.00	-0.50	5.80	6.28	6.23	9.00	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	9.25	-0.50	10.30	11.44	11.78	16.75	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	13.00	-0.50	14.30	16.13	16.86	23.75	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	4.25	0.00	4.50	5.16	5.56	9.00	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	8.00	0.00	8.50	9.85	10.64	16.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	3.75	0.00	4.00	4.69	5.08	7.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	6.75	0.00	7.45	7.78	7.90	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	15.00	-0.50	16.25	17.31	17.96	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	8.25	-0.50	8.80	9.54	10.05	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	4.25	0.00	4.10	3.76	3.39	5.75	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.75	0.00	4.60	4.09	3.19	9.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	3.75	0.25	3.40	3.11	-0.38	12.75	-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	1.4820	0.00	1Y	-2.70	0.25	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5560	0.50	1.5Y	-6.60	0.00	-0.20	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6100	0.50	2Y	-9.00	0.00	-1.95	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6700	0.00	3Y	-10.00	0.00	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.7750	-0.50	4Y	-16.25	0.50	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8350	-0.50	5Y	-18.50	0.50	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0450	-0.20	7Y	-32.75	0.20	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.1400	-0.20	10Y	-34.00	-0.30	-12.95	-37.25	6.00	-37.25	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1139.80	(-0.40)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-58.50	1.25	0.8700	1.50	1.4000	0.7650	1*2Y	11.00	-2.50	
1.5Y	-57.00	-0.50	0.9200	0.00	1.2850	0.8100	2*3Y	10.00	-0.50	
2Y	-54.00	-1.50	0.9800	-1.00	1.2600	0.7950	2*5Y	16.50	-0.50	
3Y	-49.00	-1.50	1.0800	-1.50	1.3550	0.7350	3*4Y	4.50	0.00	
4Y	-48.75	-1.50	1.1250	-1.50	1.4050	0.6900	3*5Y	6.50	0.00	
5Y	-50.50	-1.50	1.1450	-1.50	1.4500	0.6600	4*5Y	2.00	0.00	
7Y	-54.25	0.00	1.1750	0.00	1.4900	0.6550	5*7Y	3.00	1.50	
10Y	-52.50	2.50	1.2750	2.00	1.9050	0.6300	5*10Y	13.00	3.50	

TODAY DEAL LEVEL							
IRS	Lv.	ODD Tenor	9Y 78.25				
06M	42.75						
09M	44.5						
01Y							
1.5Y	49						
02Y	52	SPRD	6*9M 1.75				
03Y	57.25 / 57.5						
04Y			6*9*12m fly 0.5				
05Y	65.25 / 65.5						
07Y							
10Y	80 / 80.25 / 80.5						
12Y							
15Y							
20Y	84						
CRS							
TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	98건 (0건)	KTB	109.49	0.00	109.48	109.51	109.46
금 액	37,230억원 (+14,310억원)	LKTB	125.46	7.00	125.31	125.49	125.31

장중동향

금일 채권은 보험권에서 등락을 거듭하며 혼조세를 보임. 3년선물이 5틱, 10년선물이 18틱 사이에서 움직 이다가 3년선물 보합, 10년선물 강보합 마감.

IRS는 3년과, 10년으로 집중되었던 거래가 전테너로 분산되면서 활발히 거래되는 모습. 단기는 비드가 장 기는 오퍼가 꾸준히 나오며 커브 플랫닝. 단기쪽은 포린오퍼와 로컬/증권 비드가 눈에 띄었고, 몇몇 기관 이 대량으로 폐이. 10년은 계속되는 증권비드에 포린도 가세했지만 역외로 추정되는 오퍼가 많았고, 10*20 년 커브 비드로 나오는 10년 오퍼가 많아 레벨 하락. 20년관련 스프레드와, 아웃라인 모두 거래.

CRS는 에셋스왑 유입으로 2년~6년 중기구간 레벨 하락 마감.

ETC