

IPS Daily Closing Brief

2017-04-21

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	1.4300	1.00	1.4250	1.4454	1.4791	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875	
9M	1.4525	1.00	1.4435	1.4608	1.4885	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500	
1Y	1.4650	1.00	1.4555	1.4739	1.4983	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200	
1.5Y	1.5050	1.50	1.4910	1.5093	1.5299	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5375	1.75	1.5225	1.5415	1.5615	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.5950	2.50	1.5790	1.6036	1.6240	1.7925	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6375	2.50	1.6225	1.6548	1.6793	1.8700	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.6775	2.75	1.6620	1.7011	1.7300	1.9375	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7475	3.00	1.7345	1.7790	1.8088	2.0325	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8400	4.00	1.8225	1.8735	1.9092	2.1400	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.8825	4.00	1.8640	1.9115	1.9433	2.1975	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.8875	4.00	1.8690	1.9150	1.9415	2.2300	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.8800	4.25	1.8580	1.9061	1.9069	2.2675	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	2.25	0.50	1.85	1.54	0.94	2.50	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	1.25	0.00	1.20	1.31	0.97	2.50	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	7.25	0.75	6.70	6.76	6.32	9.50	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	5.75	0.75	5.65	6.21	6.25	9.00	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	10.00	0.75	10.00	11.33	11.78	16.75	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	14.00	1.00	13.95	15.96	16.85	23.75	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	4.25	0.00	4.35	5.11	5.54	9.00	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	8.25	0.25	8.30	9.75	10.60	16.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	4.00	0.25	3.95	4.64	5.07	7.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	7.00	0.25	7.25	7.79	7.88	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	16.25	1.25	16.05	17.24	17.92	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	9.25	1.00	8.80	9.45	10.04	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	4.25	0.00	4.15	3.80	3.41	5.75	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.75	0.00	4.65	4.15	3.24	9.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	4.00	0.25	3.55	3.26	-0.23	12.75	-11.00	31.00	-11.00	
BOND			BOND SWAP SPRD			(1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가,민평평균 기준)				
Tenor	Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
1Y	1.4840	0.20	1Y	-1.90	0.80	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5630	0.70	1.5Y	-5.80	0.80	-0.20	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6200	1.00	2Y	-8.25	0.75	-1.95	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6830	1.30	3Y	-8.80	1.20	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.7930	1.80	4Y	-15.55	0.70	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8570	2.20	5Y	-17.95	0.55	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0700	2.50	7Y	-32.25	0.50	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.1670	2.70	10Y	-32.70	1.30	-12.95	-37.25	6.00	-37.25	

BASIS SWAP			CRS		USD/KRW		1134.40	(-5.40)	
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-59.00	-0.50	0.8750	0.50	1.4000	0.7650	1*2Y	12.00	1.00
1.5Y	-57.00	0.00	0.9350	1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	10.50	0.50
2Y	-54.25	-0.25	0.9950	1.50	1.2600	0.7950	2*5Y	19.50	3.00
3Y	-49.50	-0.50	1.1000	2.00	1.3550	0.7350	3*4Y	5.50	1.00
4Y	-48.25	0.50	1.1550	3.00	1.4050	0.6900	3*5Y	9.00	2.50
5Y	-48.75	1.75	1.1900	4.50	1.4500	0.6600	4*5Y	3.50	1.50
7Y	-52.25	2.00	1.2250	5.00	1.4900	0.6550	5*7Y	3.50	0.50
10Y	-50.00	2.50	1.3400	6.50	1.9050	0.6300	5*10Y	15.00	2.00

TODAY DEAL LEVEL									
IRS	Lv.			ODD Tenor					
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	50 / 50.25								
02Y				SPRD	2*3Y	5.25			
03Y	58.25 / 58.5 / 59 / 59.5 / 59.75				2*10Y	30.5			
04Y	62.75				3*4Y	4.25			
05Y	67.25								
07Y	73.25 / 73.5								
10Y	81.5 / 82 / 82.25 / 82.75 / 84								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1Y 87								
	4Y 13.5								
TODAY KRX CCP				국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황				KTB	109.43	-0.06	109.46	109.47	109.43
금 액				LKTB	125.22	-0.24	125.36	125.36	125.16

장중동향

전일 미 국채금리는 스티븐 므누신 미 재무장관이 세제개편안을 곧 발표할 것이라고 공개하면서 나스닥 지수가 사상 최고치를 기록하는 등 위험선호 심리가 강해져 상승.

국채선물, 프랑스 대통령 선거 1차 투표를 앞두고 안전자산 선호 심리가 다소 완화된 데 따라 약세 출발. PD 협의회 일정이나 다음 주 입찰 대기 심리 등으로 시장 전반이 잠잠한 편.

IRS, 채권 움직임에 연동되어 금리 상승. 커브 스티프닝.

전체적인 거래 건수는 많지 않았지만 오늘도 3년과 10년 거래가 오전부터 꾸준히 이어짐.

CRS도 최근 지속적으로 레벨을 낮췄던 금리가 전일 주춤하더니 오늘은 상승 마감. 커브 스티프닝.

ETC