

IPS Daily Closing Brief

2017-04-24

IRS			91d CD			1.42	(0.00)	CALL	1.24	(+0.01)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.4350	0.50	1.4270	1.4431	1.4783	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875	
9M	1.4625	1.00	1.4475	1.4594	1.4882	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500	
1Y	1.4825	1.75	1.4615	1.4730	1.4983	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200	
1.5Y	1.5225	1.75	1.4980	1.5089	1.5303	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5625	2.50	1.5310	1.5418	1.5623	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6250	3.00	1.5880	1.6039	1.6250	1.7850	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6750	3.75	1.6325	1.6550	1.6803	1.8450	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.7175	4.00	1.6720	1.7013	1.7307	1.9150	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7825	3.50	1.7415	1.7789	1.8092	2.0150	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8850	4.50	1.8325	1.8735	1.9095	2.1350	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.9250	4.25	1.8740	1.9118	1.9438	2.1925	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9325	4.50	1.8795	1.9156	1.9424	2.2250	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.9300	5.00	1.8705	1.9074	1.9089	2.2525	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	2.75	0.50	2.05	1.63	1.00	2.75	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	2.00	0.75	1.40	1.36	1.00	2.50	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	8.00	0.75	6.95	6.88	6.40	9.00	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	6.25	0.50	5.70	6.21	6.27	8.25	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	11.25	1.25	10.15	11.33	11.80	16.75	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	15.50	1.50	14.10	15.95	16.85	23.75	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.00	0.75	4.45	5.11	5.53	9.00	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	9.25	1.00	8.40	9.74	10.58	16.00	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	4.25	0.25	3.95	4.63	5.05	7.25	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	6.50	-0.50	6.95	7.76	7.85	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	16.75	0.50	16.05	17.23	17.88	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	10.25	1.00	9.10	9.46	10.03	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	4.00	-0.25	4.15	3.83	3.43	5.75	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.75	0.00	4.70	4.21	3.29	9.25	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	4.50	0.50	3.80	3.39	-0.06	12.75	-11.00	31.00	-11.00	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1129.90	(-4.50)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-53.75	5.25	0.9450	7.00	1.4000	0.7650	1*2Y	11.50	-0.50	
1.5Y	-52.25	4.75	1.0000	6.50	1.2850	0.8100	2*3Y	10.50	0.00	
2Y	-50.25	4.00	1.0600	6.50	1.2600	0.7950	2*5Y	19.50	0.00	
3Y	-46.00	3.50	1.1650	6.50	1.3550	0.7350	3*4Y	5.50	0.00	
4Y	-45.50	2.75	1.2200	6.50	1.4050	0.6900	3*5Y	9.00	0.00	
5Y	-46.25	2.50	1.2550	6.50	1.4500	0.6600	4*5Y	3.50	0.00	
7Y	-48.75	3.50	1.2950	7.00	1.4900	0.6550	5*7Y	4.00	0.50	
10Y	-47.50	2.50	1.4100	7.00	1.9050	0.6300	5*10Y	15.50	0.50	

TODAY DEAL LEVEL							
IRS	Lv.	ODD Tenor					
06M							
09M							
01Y	48.25						
1.5Y							
02Y	56.25	SPRD	1*2y 08				
03Y	62.25 / 62.5 / 62.75 / 63		2*5y 15.5				
04Y	67		3*4y 4.75				
05Y	71.5 / 72.5 / 72.25						
07Y	78.25						
10Y	88.25 / 88.5 / 88.75						
12Y							
15Y							
20Y							
CRS							
TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황 84건 (+4건)		KTB	109.38	-0.05	109.35	109.38	109.32
금 액 14,193억원 (-8,217억원)		LKTB	124.84	-0.38	124.8	124.86	124.68

장중동향

프랑스 대선 1차 투표를 통해 불확실성이 완화돼 안전자산 선호현상이 약해졌지만, 장중 저가매수가 들어오면서 낙폭을 줄인 뒤 관망. 20년 입찰은 무난하게 마무리.

IRS도 채권약세를 따라 금리가 상승했는데 장기쪽 상승세가 두드러지며 커브 스티프닝 마감. IRS는 채권보다 더 약한 모습을 보이며 본스스왑 스프레드 축소.

CRS는 부채스왑 영향으로 이틀연속 큰폭으로 상승.

ETC

통안 1y 9000억 입찰 >> 1.49% 낙찰

통안 91d 9000억 입찰 >> 1.34% 낙찰

국고 20y 8000억 입찰 >> 2.34% 낙찰