IPS Daily Closing Brief

2017-04-25

IRS				91d CD	1.42	(0.00)	CALL	1.24	(0.00)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4325	-0.25	1.4290	1.4404	1.4771	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875
9M	1.4600	-0.25	1.4515	1.4575	1.4875	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500
1Y	1.4850	0.25	1.4680	1.4715	1.4980	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200
1.5Y	1.5250	0.25	1.5055	1.5079	1.5302	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5600	-0.25	1.5390	1.5411	1.5623	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.6225	-0.25	1.5965	1.6034	1.6251	1.7850	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6725	-0.25	1.6420	1.6545	1.6803	1.8450	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.7200	0.25	1.6830	1.7010	1.7306	1.9150	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7850	0.25	1.7500	1.7785	1.8086	2.0150	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8875	0.25	1.8435	1.8733	1.9089	2.1350	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.9300	0.50	1.8855	1.9119	1.9435	2.1925	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.9350	0.25	1.8910	1.9160	1.9423	2.2250	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.9325	0.25	1.8840	1.9084	1.9099	2.2525	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	2.75	0.00	2.25	1.71	1.04	2.75	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	2.50	0.50	1.65	1.40	1.04	2.50	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	7.50	-0.50	7.10	6.96	6.44	9.00	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	6.25	0.00	5.75	6.23	6.28	8.25	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	11.25	0.00	10.30	11.34	11.79	16.75	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.00	0.50	14.40	15.99	16.83	23.75	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.00	0.00	4.55	5.11	5.52	9.00	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	0.50	8.65	9.76	10.55	16.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.75	0.50	4.10	4.65	5.03	7.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.50	0.00	6.70	7.75	7.80	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	16.75	0.00	16.05	17.23	17.83	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	10.25	0.00	9.35	9.48	10.03	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.25	0.25	4.20	3.86	3.46	5.75	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.00	4.75	4.28	3.34	9.25	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	4.50	0.00	4.05	3.51	0.10	12.00	-11.00	31.00	-11.00

BOND			BOND SWAP SPRD (1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)						
Tenor	Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.4760	-0.80	1Y	0.90	1.05	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5650	-1.00	1.5Y	-4.00	1.25	-0.20	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.6220	-1.30	2Y	-6.20	1.05	-1.95	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6750	-2.00	3Y	-5.25	1.75	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.7950	-1.50	4Y	-12.25	1.25	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8620	-1.80	5Y	-14.20	2.05	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0890	-1.30	7Y	-30.40	1.55	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.1920	-1.00	10Y	-30.45	1.25	-12.95	-37.25	6.00	-37.25

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1125.40	(-4.50)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-55.00	-1.25	0.9350	-1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	11.50	0.00
1.5Y	-54.00	-1.75	0.9850	-1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	10.00	-0.50
2Y	-51.00	-0.75	1.0500	-1.00	1.2600	0.7950	2*5Y	18.00	-1.50
3Y	-47.25	-1.25	1.1500	-1.50	1.3550	0.7350	3*4Y	5.50	0.00
4Y	-46.75	-1.25	1.2050	-1.50	1.4050	0.6900	3*5Y	8.00	-1.00
5Y	-49.00	-2.75	1.2300	-2.50	1.4500	0.6600	4*5Y	2.50	-1.00
7Y	-50.50	-1.75	1.2800	-1.50	1.4900	0.6550	5*7Y	5.00	1.00
10Y	-47.75	-0.25	1.4100	0.00	1.9050	0.6300	5*10Y	18.00	2.50

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	
09M	46		
01Y	48.5		
1.5Y	52.25 / 52.5		
02Y	55.75	SPRD	9M*1.5Y 06
03Y	62 / 62.5		1*2Y 08
04Y			2*3Y 6.25
05Y	71.5 / 72 / 72.25		5*10Y 16.75
07Y	78		7*12Y 14
10Y	88 / 88.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2Y 5.5 3Y 15		

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	95건 (+11)	KTB	109.43	0.05	109.41	109.44	109.36
금 액	22,945억원 (+8,752억원)	LKTB	124.94	0.1	124.96	125.02	124.79

장중동향

미 국채 시장은 전일 프랑스 대선 1차 투표 종료에 따른 안전자산 회피 분위기를 반영해 약세 마감했지만, 국내 시장은 전일 먼저 반영하면서 미 동향이 미치는 영향은 제한적. 북한 인민군 창건일을 맞아 핵실험에 대한 긴장감이 있었지만 관련 소식은 없음. 국채선물은 은행권의 매수가 강세를 이끄는 모습.

IRS는 국채선물이 반등하면서 금리가 약간 빠졌었지만 결국 단기는 소폭 하락, 중장기는 소폭 상승 마감. 중기 구간을 중심으로 본드스왑 축소가 진행.
장 초반, 5년이 71.5에 여러번 거래되며 잠시 활기를 띄었지만 이내 조용한 분위기를 유지. 오후들어 전반적 거래량이 증가하면서 71.5, 72에 꾸준히 거래. 동시호가 이후 72.25 까지 거래 지속. 3y도 거래가 활발.
5*10y,7*12y 등 중장기 스프레드 거래 소식도 들려옴.

CRS는 그동안 부채스왑 헤지 물량으로 비디쉬해 레벨이 올랐지만, 오늘은 오퍼가 나오면서 장기구간을 제외하고는 금리가 전반적으로 소폭 하락 마감. 2y,3y 위주로 호가가 대치되면서 거래

ETC

국고 3년 16-7호 장내거래량 14.5조원...월중 최고 기록