

IPS Daily Closing Brief

2017-04-28

IRS			91d CD			1.41	(0.00)	CALL	1.22	(0.00)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min	
6M	1.4225	0.00	1.4280	1.4351	1.4736	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875	
9M	1.4500	-0.25	1.4565	1.4545	1.4854	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500	
1Y	1.4775	0.00	1.4810	1.4700	1.4970	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200	
1.5Y	1.5200	-0.25	1.5240	1.5079	1.5303	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5550	0.00	1.5590	1.5411	1.5629	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6175	0.00	1.6215	1.6026	1.6260	1.7850	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6700	0.00	1.6730	1.6534	1.6810	1.8450	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.7200	0.00	1.7205	1.7001	1.7311	1.9050	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.7900	-0.25	1.7895	1.7770	1.8084	1.9925	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.8950	-0.50	1.8945	1.8730	1.9087	2.1025	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.9350	-0.50	1.9350	1.9124	1.9439	2.1575	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9400	-0.50	1.9405	1.9170	1.9435	2.1850	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.9375	-0.50	1.9380	1.9094	1.9147	2.2175	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	2.75	-0.25	2.85	1.94	1.18	3.00	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	2.75	0.25	2.45	1.55	1.16	2.75	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	7.75	0.00	7.80	7.11	6.59	9.00	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	6.25	0.00	6.25	6.15	6.30	8.00	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	11.50	0.00	11.40	11.23	11.80	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	16.50	0.00	16.15	15.90	16.82	21.50	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.25	0.00	5.15	5.08	5.50	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	10.25	0.00	9.90	9.75	10.51	14.25	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	5.00	0.00	4.75	4.68	5.01	6.75	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	7.00	-0.25	6.90	7.69	7.73	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	17.50	-0.50	17.40	17.29	17.76	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	10.50	-0.25	10.50	9.60	10.03	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	4.00	0.00	4.05	3.94	3.52	5.75	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.50	0.00	4.60	4.40	3.48	9.00	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	4.25	0.00	4.35	3.64	0.60	12.00	-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	1.4530	-0.70	1Y	2.45	0.70	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5350	-1.00	1.5Y	-1.50	0.75	-0.20	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6060	0.10	2Y	-5.10	-0.10	-1.95	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6700	0.00	3Y	-5.25	0.00	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.7920	0.20	4Y	-12.20	-0.20	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8620	0.20	5Y	-14.20	-0.20	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0780	-0.40	7Y	-28.80	0.15	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.1920	-0.30	10Y	-29.70	-0.20	-12.95	-37.25	6.00	-37.25	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1137.90	(+7.80)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-58.25	-3.00	0.8950	-3.00	1.4000	0.7650	1*2Y	9.50	0.00	
1.5Y	-58.50	-2.75	0.9350	-3.00	1.2850	0.8100	2*3Y	10.00	-0.50	
2Y	-56.50	-3.00	0.9900	-3.00	1.2600	0.7950	2*5Y	18.50	-0.50	
3Y	-52.75	-3.50	1.0900	-3.50	1.3550	0.7350	3*4Y	6.00	0.00	
4Y	-52.00	-3.50	1.1500	-3.50	1.4050	0.6900	3*5Y	8.50	0.00	
5Y	-54.50	-3.50	1.1750	-3.50	1.4500	0.6600	4*5Y	2.50	0.00	
7Y	-57.00	-3.25	1.2200	-3.50	1.4900	0.6550	5*7Y	4.50	0.00	
10Y	-54.50	-2.50	1.3500	-3.00	1.9050	0.6300	5*10Y	17.50	0.50	

TODAY DEAL LEVEL								
IRS	Lv.		ODD Tenor					
06M								
09M	45							
01Y								
1.5Y								
02Y	55.25 / 55.5		SPRD	1.5*2y	3.25			
03Y	61.5 / 61.75			5*10y	17.75			
04Y	66.75 / 67							
05Y	71.75							
07Y								
10Y	89.5							
12Y								
15Y								
20Y								
CRS								
TODAY KRX CCP			국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	53건(-40건)		KTB	109.44	-0.01	109.48	109.48	109.42
금 액	9,395억원(-16,270억원)		LKTB	124.96	0.06	125.02	125.04	124.87

장중동향

금일 채권은 연휴를 앞두고 큰 이슈없이 혼조세를 보이다가 보험권으로 마감. 장초반 강세로 시작한 국채 선물은 외국인의 매도세에 등락을 반복하다가 3년선물 109.44(-1틱) 10년선물 124.96(+6틱) 으로 마감.

IRS는 장 초반 5년이 71.75에 엔디간 거래로 수차례거래되는 모습을 보였고, 이후엔 한산한 모습. 오후에는 비드가 없는가운데 전테너 오퍼가 비드를 찾으며 장기쪽만 0.5bp정도 놀리며 소폭 커브 플랫마감.

CRS는 어제에 이어 에셋물량으로 하락 마감.

ETC