

IPS Daily Closing Brief

2017-05-04

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	1.4200	-0.25	1.4230	1.4319	1.4713	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875	
9M	1.4450	-0.75	1.4515	1.4528	1.4839	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500	
1Y	1.4725	-1.00	1.4785	1.4700	1.4964	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200	
1.5Y	1.5175	-1.25	1.5240	1.5090	1.5305	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900	
2Y	1.5525	-1.50	1.5585	1.5428	1.5634	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675	
3Y	1.6225	-1.50	1.6240	1.6044	1.6267	1.7850	1.1550	3.0650	1.1550	
4Y	1.6750	-1.75	1.6770	1.6551	1.6815	1.8450	1.1575	3.1875	1.1575	
5Y	1.7275	-2.00	1.7280	1.7024	1.7316	1.9050	1.1575	3.3050	1.1575	
7Y	1.8025	-2.25	1.8015	1.7780	1.8086	1.9925	1.1675	3.4625	1.1675	
10Y	1.9050	-2.50	1.9070	1.8753	1.9086	2.1025	1.2125	3.6250	1.2125	
12Y	1.9450	-2.50	1.9470	1.9159	1.9442	2.1575	1.2150	3.6575	1.2150	
15Y	1.9475	-2.75	1.9515	1.9206	1.9442	2.1850	1.2150	3.6675	1.2150	
20Y	1.9475	-2.50	1.9495	1.9131	1.9181	2.2175	1.2150	3.8075	1.2150	
6*9M	2.50	-0.50	2.85	2.09	1.26	3.00	-6.00	4.25	-6.50	
9*12M	2.75	-0.25	2.70	1.73	1.25	3.00	-4.00	4.50	-5.75	
1*2Y	8.00	-0.50	8.00	7.28	6.70	9.00	-5.50	16.25	-8.75	
2*3Y	7.00	0.00	6.55	6.16	6.33	8.00	-1.75	15.00	-1.75	
2*4Y	12.25	-0.25	11.85	11.24	11.81	15.25	-1.75	28.25	-1.75	
2*5Y	17.50	-0.50	16.95	15.96	16.82	21.25	-1.75	39.25	-1.75	
3*4Y	5.25	-0.25	5.30	5.08	5.48	7.75	-0.50	14.00	-0.50	
3*5Y	10.50	-0.50	10.40	9.80	10.49	14.25	-0.50	25.00	-0.50	
4*5Y	5.25	-0.25	5.10	4.73	5.01	6.75	-0.25	11.75	-0.25	
5*7Y	7.50	-0.25	7.35	7.56	7.70	10.50	0.25	16.25	0.25	
5*10Y	17.75	-0.50	17.90	17.29	17.70	22.25	3.75	32.25	3.75	
7*10Y	10.25	-0.25	10.55	9.73	10.00	12.75	3.00	16.75	3.00	
10*12Y	4.00	0.00	4.00	4.06	3.56	5.75	-0.25	7.75	-0.25	
10*15Y	4.25	-0.25	4.45	4.54	3.56	9.00	-0.75	15.00	-0.75	
10*20Y	4.25	0.00	4.25	3.79	0.95	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	1.4420	-0.40	1Y	3.05	-0.60	5.75	-17.75	13.00	-17.75	
1.5Y	1.5300	-0.50	1.5Y	-1.25	-0.75	-0.20	-19.10	9.75	-19.10	
2Y	1.6100	2.90	2Y	-5.75	-4.40	-1.35	-25.15	9.50	-25.15	
3Y	1.6820	-0.30	3Y	-5.95	-1.20	4.75	-19.50	11.00	-19.50	
4Y	1.8070	-1.30	4Y	-13.20	-0.45	-3.20	-30.35	5.75	-30.35	
5Y	1.8840	-1.30	5Y	-15.65	-0.70	-2.25	-27.25	8.50	-27.25	
7Y	2.0980	-2.00	7Y	-29.55	-0.25	-7.50	-37.65	2.00	-37.65	
10Y	2.2120	-2.50	10Y	-30.70	0.00	-12.95	-37.25	6.00	-37.25	

BASIS SWAP			CRS			USD/KRW			1132.70	(+2.20)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
1Y	-55.25	2.50	0.9200	1.50	1.4000	0.7650	1*2Y	8.50	-1.50	
1.5Y	-56.25	2.25	0.9550	1.00	1.2850	0.8100	2*3Y	10.00	0.00	
2Y	-54.75	1.50	1.0050	0.00	1.2600	0.7950	2*5Y	19.00	-0.50	
3Y	-51.75	1.50	1.1050	0.00	1.3550	0.7350	3*4Y	6.00	-0.50	
4Y	-51.00	1.25	1.1650	-0.50	1.4050	0.6900	3*5Y	9.00	-0.50	
5Y	-53.25	1.50	1.1950	-0.50	1.4500	0.6600	4*5Y	3.00	0.00	
7Y	-56.25	1.75	1.2400	-0.50	1.4900	0.6550	5*7Y	4.50	0.00	
10Y	-53.50	2.00	1.3700	-0.50	1.9050	0.6300	5*10Y	17.50	0.00	

TODAY DEAL LEVEL							
IRS	Lv.	ODD Tenor					
06M	42						
09M	45.5 / 44.5						
01Y							
1.5Y							
02Y		SPRD	1*2y 8.5				
03Y	62.5		12*20y 00				
04Y							
05Y							
07Y							
10Y	94						
12Y							
15Y							
20Y							
CRS							
TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	40건 (-14건)	KTB	109.41	0.03	109.36	109.42	109.34
금 액	10,610억원 (-150억원)	LKTB	124.8	0.3	124.47	124.84	124.34

장중동향

금일 채권은 연휴를 앞두고 시장 참가자들이 적은 가운데 외국인들이 시장을 주도. 외인이 매수에 나서면서 3년선물 109.41(+3틱), 10년선물 124.80(+30)으로 가격 상승 마감.

IRS는 채권강세에 금리 하락, 장기물의 하락폭이 커지면서 커브 플랫마감. 연휴를 앞두고 스왑은 거래없이 한산한 모습. 거래는 많지 않았지만 CD 발행등의 영향으로 6개월, 9개월쪽 단기 거래가 주로 발생.

CRS는 보험권에서 움직이며 1년 구간으로만 비드가 나오며 레벨 상승 마감.

ETC