IPS Daily Closing Brief

2017-04-13

IRS				91d CD	1.43	(0.00)	CALL	1.23	(0.00)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4250	-0.50	1.4395	1.4646	1.4848	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875
9M	1.4425	-0.50	1.4560	1.4775	1.4919	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500
1Y	1.4525	-0.75	1.4690	1.4899	1.5005	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200
1.5Y	1.4875	-1.25	1.5070	1.5254	1.5298	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5200	-1.25	1.5405	1.5578	1.5599	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.5825	-1.00	1.6015	1.6213	1.6211	1.7925	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6350	-1.25	1.6555	1.6749	1.6777	1.8700	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.6800	-2.00	1.7075	1.7245	1.7298	1.9375	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7575	-2.50	1.7915	1.8025	1.8095	2.0325	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8500	-2.75	1.8875	1.8995	1.9108	2.1400	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.8900	-2.75	1.9275	1.9359	1.9436	2.1975	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.8950	-2.75	1.9325	1.9376	1.9403	2.2300	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.8825	-3.00	1.9220	1.9230	1.8998	2.2675	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	1.75	0.00	1.65	1.29	0.71	2.50	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	1.00	-0.25	1.30	1.24	0.85	2.50	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	6.75	-0.50	7.15	6.79	5.95	9.50	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	6.25	0.25	6.10	6.35	6.12	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	11.50	0.00	11.50	11.71	11.78	16.75	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	16.00	-0.75	16.70	16.68	16.99	23.75	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	5.25	-0.25	5.40	5.36	5.66	9.00	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	9.75	-1.00	10.60	10.33	10.88	16.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	4.50	-0.75	5.20	4.96	5.21	7.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	7.75	-0.50	8.40	7.80	7.97	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	17.00	-0.75	18.00	17.50	18.10	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	9.25	-0.25	9.60	9.70	10.13	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.00	0.00	4.00	3.64	3.28	6.00	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.50	0.00	4.50	3.81	2.95	9.25	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.25	-0.25	3.45	2.35	-1.10	13.00	-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	1.4650	0.40	1Y	-1.25	-1.15	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5420	-0.30	1.5Y	-5.45	-0.95	-0.20	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.5970	-0.30	2Y	-7.70	-0.95	-1.95	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6720	-1.50	3Y	-8.95	0.50	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.7850	-2.30	4Y	-15.00	1.05	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8520	-3.00	5Y	-17.20	1.00	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0700	-3.10	7Y	-31.25	0.60	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.1750	-3.20	10Y	-32.50	0.45	-12.95	-37.25	6.00	-37.25

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1129.70	(-11.70)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-59.75	-2.25	0.8550	-3.00	1.4000	0.7650	1*2Y	15.50	2.00
1.5Y	-55.75	-0.25	0.9300	-1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	12.50	-1.00
2Y	-51.00	0.25	1.0100	-1.00	1.2600	0.7950	2*5Y	22.00	-3.00
3Y	-44.75	-1.00	1.1350	-2.00	1.3550	0.7350	3*4Y	6.00	-0.50
4Y	-44.00	-1.25	1.1950	-2.50	1.4050	0.6900	3*5Y	9.50	-2.00
5Y	-45.00	-2.00	1.2300	-4.00	1.4500	0.6600	4*5Y	3.50	-1.50
7Y	-49.75	-1.50	1.2600	-4.00	1.4900	0.6550	5*7Y	3.00	0.00
10Y	-49.50	-1.75	1.3550	-4.50	1.9050	0.6300	5*10Y	12.50	-0.50

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	454 / 45.25		
1.5Y			
02Y	51 / 51.25 / 51.75 / 52	SPRD	1*2Y 06
03Y	57.75 / 58 / 58.5		1*3Y 11.75
04Y	61.75 / 63		2*10Y 31
05Y	66.5 / 68 / 68.25		3*4Y 5.25
07Y	74		
10Y	83		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP		국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	93건 (-12건)	KTB	109.45	5.00	109.48	109.52	109.40
금 액	24,662억원 (+667억원)	LKTB	125.01	29.00	125.10	125.31	124.82

장중동향

한은이 올해 경제성장률 전망치를 높였지만, 달러-원 환율이 급락하면서 주가와 원화, 채권이 트리플 강세를 보임.
채권은 미금리하락과 한국은행 총재의 비둘기적 발언으로 강세 마감.

IRS는 어느정도 지정학적리스크가 해서되면서 채권과 연동되어 하락. 3년 이하로 본드스왑 스프레드 역전폭 축소를 노린 비드를 제외하고는 비드가 나오면 기븐되며 거래. 전체적으로 레벨 하락했으며 커브는 플래트닝 마감.

CRS는 에셋이 크게 나오지 않은 상황임에도 꾸준한 오퍼가 나오며 레벨 하락. 부채스왑 물량이 일단란 되면서 오퍼가 꾸준한것으로 보임.

ETC

<<4월 13일 Market Point>>
한은 금통위 금리결정 - 동결(만장일치)

한은, 올해 경제성장률 전망치 2.6%...3년 만에 상향조정

한은RP 14일물 6.0조 낙찰 1.27%
한은RP 7일물 9.4조 낙찰 1.25%