IPS Daily Closing Brief

2017-04-19

IRS				91d CD	1.42	(0.00)	CALL	1.23	(0.00)
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4225	0.00	1.4245	1.4515	1.4809	1.6725	1.2875	2.8575	1.2875
9M	1.4400	0.00	1.4420	1.4659	1.4894	1.6850	1.2500	2.8300	1.2500
1Y	1.4525	0.00	1.4540	1.4788	1.4988	1.6925	1.2200	2.8200	1.2200
1.5Y	1.4850	-0.25	1.4885	1.5139	1.5294	1.7125	1.1900	2.8725	1.1900
2Y	1.5150	-0.50	1.5205	1.5461	1.5606	1.7300	1.1675	2.9350	1.1675
3Y	1.5700	-1.00	1.5810	1.6093	1.6228	1.7925	1.1550	3.0650	1.1550
4Y	1.6125	-1.25	1.6280	1.6614	1.6786	1.8700	1.1575	3.1875	1.1575
5Y	1.6500	-1.50	1.6695	1.7089	1.7296	1.9375	1.1575	3.3050	1.1575
7Y	1.7175	-2.50	1.7460	1.7866	1.8090	2.0325	1.1675	3.4625	1.1675
10Y	1.8050	-2.75	1.8360	1.8826	1.9098	2.1400	1.2125	3.6250	1.2125
12Y	1.8475	-2.50	1.8765	1.9199	1.9435	2.1975	1.2150	3.6575	1.2150
15Y	1.8525	-2.50	1.8815	1.9229	1.9412	2.2300	1.2150	3.6675	1.2150
20Y	1.8400	-2.50	1.8690	1.9124	1.9045	2.2675	1.2150	3.8075	1.2150
6*9M	1.75	0.00	1.75	1.44	0.85	2.50	-6.00	4.25	-6.50
9*12M	1.25	0.00	1.20	1.29	0.93	2.50	-4.00	4.50	-5.75
1*2Y	6.25	-0.50	6.65	6.74	6.18	9.50	-5.50	16.25	-8.75
2*3Y	5.50	-0.50	6.05	6.31	6.22	9.00	-1.75	15.00	-1.75
2*4Y	9.75	-0.75	10.75	11.53	11.80	16.75	-1.75	28.25	-1.75
2*5Y	13.50	-1.00	14.90	16.28	16.90	23.75	-1.75	39.25	-1.75
3*4Y	4.25	-0.25	4.70	5.21	5.58	9.00	-0.50	14.00	-0.50
3*5Y	8.00	-0.50	8.85	9.96	10.68	16.00	-0.50	25.00	-0.50
4*5Y	3.75	-0.25	4.15	4.75	5.10	7.25	-0.25	11.75	-0.25
5*7Y	6.75	-1.00	7.65	7.78	7.93	10.50	0.25	16.25	0.25
5*10Y	15.50	-1.25	16.65	17.38	18.02	22.25	3.75	32.25	3.75
7*10Y	8.75	-0.25	9.00	9.60	10.09	12.75	3.00	16.75	3.00
10*12Y	4.25	0.25	4.05	3.73	3.36	5.75	-0.25	7.75	-0.25
10*15Y	4.75	0.25	4.55	4.03	3.14	9.25	-0.75	15.00	-0.75
10*20Y	3.50	0.25	3.30	2.98	-0.53	12.75	-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	1.4820	0.70	1Y	-2.95	-0.70	5.75	-17.75	13.00	-17.75
1.5Y	1.5510	0.40	1.5Y	-6.60	-0.65	-0.20	-19.10	9.75	-19.10
2Y	1.6050	0.00	2Y	-9.00	-0.50	-1.95	-25.15	9.50	-25.15
3Y	1.6700	-0.50	3Y	-10.00	-0.50	4.75	-19.50	11.00	-19.50
4Y	1.7800	-0.70	4Y	-16.75	-0.55	-3.20	-30.35	5.75	-30.35
5Y	1.8400	-0.70	5Y	-19.00	-0.80	-2.25	-27.25	8.50	-27.25
7Y	2.0470	-1.70	7Y	-32.95	-0.80	-7.50	-37.65	2.00	-37.65
10Y	2.1420	-2.80	10Y	-33.70	0.05	-12.95	-37.25	6.00	-37.25

BASIS SWAP			CRS				USD/KRW	1140.20	(-2.20)
Tenor	Lv.	전일비	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-59.75	-1.00	0.8550	-1.00	1.4000	0.7650	1*2Y	13.50	-1.00
1.5Y	-56.50	-1.25	0.9200	-1.50	1.2850	0.8100	2*3Y	10.50	-1.50
2Y	-52.50	-1.50	0.9900	-2.00	1.2600	0.7950	2*5Y	17.00	-3.00
3Y	-47.50	-2.50	1.0950	-3.50	1.3550	0.7350	3*4Y	4.50	-0.50
4Y	-47.25	-2.75	1.1400	-4.00	1.4050	0.6900	3*5Y	6.50	-1.50
5Y	-49.00	-3.50	1.1600	-5.00	1.4500	0.6600	4*5Y	2.00	-1.00
7Y	-54.25	-3.00	1.1750	-5.50	1.4900	0.6550	5*7Y	1.50	-0.50
10Y	-55.00	-4.25	1.2550	-7.00	1.9050	0.6300	5*10Y	9.50	-2.00

TODAY DEAL LEVEL

IRS	Lv.		
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	44.5 / 44.75 / 45 / 45.25		
1.5Y	47.5 / 48.25 / 48.5		
02Y	50.25 / 50.75	SPRD	1*3Y 11.75
03Y	56		2*5Y 13
04Y	60 / 60.25		3*5Y 7.5
05Y	63.5 / 63.75 / 64 / 65.5		4*5Y 04
07Y			
10Y	79 / 79.25 / 79.5 / 79.75 / 80.25 / 80.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2Y 00 3y 09		

TODAY KRX CCP	국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
거래현황	98건 (+13건)	KTB	109.49	2.00	109.51	109.55	109.49
금 액	22,920억원 (+4,990억원)	LKTB	125.39	24.00	125.50	125.60	125.39

장중동향

국채 선물은 미국채 시장 랠리 영향으로 강세 출발. 지정학적 리스크 완화에 따른 외국인 매수세가 장을 이끌었지만 주 후반 프랑스 대선 이벤트를 앞두고 있어 정치적 불확실성이 불거지며 과감한 매매가 나오지 못하는 모습. 한국은행의 단순매입은 제한적인 영향을 보임.

IRS, CRS 모두 미국 금리 하락으로 장기 구간 위주로 레벨을 많이 낮춘 모습. 커브 플래트닝.

IRS는 구조화채권 영향으로 중장기구간에서 오퍼가 많이 나옴.
CRS, 에셋 영향 등으로 최근 오르는데 한계를 보이거나 상대적으로 더 빠지던 장기구간으로 갈수록 하락폭이 커짐. 특히 3y이 호가 및 거래가 활발.

ETC

*** 통안채 2년물(0160-1904-0201) 2.3조 입찰 ★1.60% 낙찰**

*** 한은 국고채 단순매입 7천억 낙찰...응찰 3.42조**

국고채 20년 경과물 13-8 : 235 ~ 245 낙찰(민2.273) / 1200억
국고채 10년 경과물 14-2 : 025 ~ 025 낙찰(민2.059) / 500억
국고채 10년 경과물 13-2 : 935 ~ 940 낙찰(민1.964) / 500억
국고채 10년 경과물 12-3 : 875 ~ 885 낙찰(민1.906) / 1900억
국고채 5년 경과물 15-4 : 725 낙찰(민1.747) / 2900억