IPS Daily Morning Brief

2019-04-22

종가 기준일 2019-04-19

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8575	0.25	1.8580	1.8656	1.8712	1.9125	1.6100	2.0875	1.2875
9M	1.8400	0.25	1.8470	1.8429	1.8594	1.9125	1.6900	2.0575	1.2500
1Y	1.8250	0.50	1.8325	1.8154	1.8415	1.9200	1.7575	2.0325	1.2200
1.5Y	1.7950	1.00	1.8005	1.7676	1.8112	2.0250	1.7125	2.0375	1.1900
2Y	1.7650	1.75	1.7630	1.7264	1.7785	2.1150	1.6725	2.1150	1.1675
3Y	1.7275	2.00	1.7270	1.6910	1.7460	2.2225	1.6350	2.2225	1.1550
4Y	1.7025	1.50	1.7085	1.6714	1.7321	2.2950	1.6150	2.2950	1.1575
5Y	1.6975	1.50	1.7025	1.6633	1.7259	2.3400	1.6050	2.3400	1.1575
7Y	1.6975	1.50	1.7020	1.6593	1.7263	2.3950	1.5950	2.3950	1.1675
10Y	1.7200	2.00	1.7255	1.6823	1.7600	2.4850	1.6150	2.4850	1.2125
12Y	1.7450	2.00	1.7505	1.7066	1.7862	2.5225	1.6425	2.5225	1.2150
15Y	1.7500	2.00	1.7540	1.7090	1.7937	2.5400	1.6450	2.5475	1.2150
20Y	1.7225	2.00	1.7265	1.6828	1.7763	2.5600	1.6225	2.7000	1.2150
6*9M	-1.75	0.00	-1.10	-2.28	-1.18	9.75	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.50	0.25	-1.45	-2.75	-1.79	8.75	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-6.00	1.25	-6.95	-8.90	-6.31	23.00	-11.00	23.00	-11.00
2*3Y	-3.75	0.25	-3.60	-3.54	-3.24	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-6.25	-0.25	-5.45	-5.50	-4.64	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-6.75	-0.25	-6.05	-6.31	-5.26	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-2.50	-0.50	-1.85	-1.96	-1.40	8.50	-2.50	11.25	-2.50
3*5Y	-3.00	-0.50	-2.45	-2.78	-2.02	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-0.50	0.00	-0.60	-0.81	-0.62	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	0.00	0.00	-0.05	-0.40	0.04	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	2.25	0.50	2.30	1.90	3.42	16.25	0.75	30.75	0.75
7*10Y	2.25	0.50	2.35	2.30	3.38	9.50	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.50	0.00	2.50	2.44	2.61	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	0.00	2.85	2.68	3.37	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	0.25	0.00	0.10	0.05	1.63	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.769	0.30	1.774	1.766	1.809	1.935	1.743	2.065	1.237
1.5Y	1.769	0.60	1.776	1.764	1.815	2.113	1.739	2.113	1.232
2Y	1.770	1.30	1.768	1.750	1.808	2.230	1.715	2.230	1.225
3Y	1.760	1.80	1.759	1.732	1.781	2.315	1.675	2.315	1.200
4Y	1.815	2.50	1.811	1.784	1.842	2.502	1.725	2.502	1.232
5Y	1.800	2.30	1.801	1.764	1.836	2.602	1.697	2.602	1.217
7Y	1.874	2.00	1.880	1.845	1.929	2.728	1.779	2.728	1.270
10Y	1.910	1.80	1.920	1.881	1.953	2.815	1.805	2.815	1.355
20Y	1.917	0.20	1.933	1.906	1.999	2.792	1.840	2.820	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.74	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.40	-0.07	109.49	109.49	109.40
LKTB	128.04	-0.19	128.33	128.34	128.02

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	5.60	0.20	5.87	4.97	3.21	6.75	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	2.60	0.40	2.41	0.41	-0.43	2.65	-15.60	2.65	-19.10
2Y	-0.50	0.45	-0.50	-2.37	-2.91	-0.25	-15.70	-0.25	-25.15
3Y	-3.25	0.20	-3.18	-4.12	-3.51	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.25	-1.00	-10.29	-11.27	-10.99	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.25	-0.80	-9.87	-10.12	-10.98	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.65	-0.50	-17.78	-18.61	-20.31	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.00	0.20	-19.47	-19.83	-19.34	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-19.45	1.80	-20.69	-22.30	-22.30	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-57.50	-1.00
-63.50	-1.00
-68.00	-1.75
-70.25	-2.00
-69.25	-1.50
-72.25	-1.50
-68.25	-1.50
-55.00	-2.00

CRS

USD/KRW 11369.90 ########

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2500	-0.50	1.5400	0.9950	1*2Y	-16.50	0.50
1.5Y	1.1600	0.00	1.5650	1.2350	2*3Y	-6.00	0.00
2Y	1.0850	0.00	1.5950	1.3200	2*5Y	-11.00	0.00
3Y	1.0250	0.00	1.6600	1.0050	3*4Y	-1.50	0.00
4Y	1.0100	0.00	1.7200	0.9550	3*5Y	-5.00	0.00
5Y	0.9750	0.00	1.7800	0.9000	4*5Y	-3.50	0.00
7Y	1.0150	0.00	1.8950	0.9400	5*7Y	4.00	0.00
10Y	1.1700	0.00	2.0500	1.1450	5*10Y	19.50	0.00

U.S. TREASURY

(한국 영업일 기준 전일비)

Tenor	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
2Y	2.3900	-0.0122	2.4022	2.4022	2.4062	2.9773	1.7363	2.9773	0.4100
10Y	2.5637	-0.0325	2.5962	2.5962	2.5935	3.2382	2.3277	3.2382	1.3600

U.S. TREASURY - KTB

(한국 영업일 기준 전일비)

Tenor	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
2Y	62.00	-2.52	64.52	62.52	63.62	103.03	-35.87	103.03	-159.50
10Y	65.37	-5.05	70.42	65.42	66.15	98.82	-19.97	98.82	-63.50

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-4.50	0.25	-4.75	-2.25	-3.25	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTB 2*10Y	14.00	0.50	13.50	16.50	16.20	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	17.37	-2.03	19.40	19.40	18.73	79.07	6.06	177.00	6.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	68.75	ODD Tenor	
09M	84		
01Y	82.5 / 82.25		
1.5Y	79.25 / 79.5		
02Y	75.5	SPRD	1*1.5Y -03
03Y	71		4*5Y -0.5
04Y			
05Y	68.25		
07Y			
10Y	71 / 70		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2y CCS 8.5 / 08		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	92 건	-58	150	157	57	84	90	106
금 액	29,316 억원	-31,510	60,826	74,370	18,510	32,765	45,356	33,155

장중동향

국고채 금리, 외인 선물 매도에 국고채 금리 상승.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.
국채선물 대비 비디쉬한 모습. 어제 금통위 이슈로 강해진 후 중장기쪽 레벨 부담.

CRS, 1Y을 제외하고 대부분 구간에서 보합 마감.