

IPS Daily Morning Brief

2019-04-01

종가 기준일 2019-03-29

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8775	0.75	1.8765	1.8874	1.8694	1.9125	1.5525	2.1000	1.2875
9M	1.8300	1.25	1.8430	1.8756	1.8596	1.9125	1.6650	2.0800	1.2500
1Y	1.7900	1.75	1.8120	1.8599	1.8441	1.9200	1.7525	2.0650	1.2200
1.5Y	1.7275	1.50	1.7610	1.8315	1.8206	2.0250	1.7125	2.0825	1.1900
2Y	1.6850	1.25	1.7215	1.8018	1.7924	2.1150	1.6725	2.1150	1.1675
3Y	1.6500	1.50	1.6845	1.7674	1.7630	2.2225	1.6350	2.2225	1.1550
4Y	1.6275	1.25	1.6635	1.7509	1.7528	2.2950	1.6150	2.2950	1.1575
5Y	1.6200	1.50	1.6535	1.7424	1.7485	2.3400	1.6050	2.3400	1.1575
7Y	1.6100	1.50	1.6430	1.7353	1.7518	2.3950	1.5950	2.4000	1.1675
10Y	1.6300	1.50	1.6650	1.7634	1.7913	2.4850	1.6150	2.5375	1.2125
12Y	1.6525	1.00	1.6910	1.7905	1.8178	2.5225	1.6425	2.5875	1.2150
15Y	1.6550	1.00	1.6960	1.7975	1.8289	2.5400	1.6450	2.6475	1.2150
20Y	1.6350	1.25	1.6755	1.7846	1.8077	2.5600	1.6225	2.8150	1.2150

6*9M	-4.75	0.50	-3.35	-1.18	-0.98	11.50	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-4.00	0.50	-3.10	-1.58	-1.55	9.50	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-10.50	-0.50	-9.05	-5.81	-5.17	23.00	-10.50	23.00	-10.50
2*3Y	-3.50	0.25	-3.70	-3.44	-2.94	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-5.75	0.00	-5.80	-5.09	-3.96	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-6.50	0.25	-6.80	-5.94	-4.39	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-2.25	-0.25	-2.10	-1.65	-1.02	8.50	-2.50	11.25	-2.50
3*5Y	-3.00	0.00	-3.10	-2.50	-1.45	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-0.75	0.25	-1.00	-0.85	-0.43	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	-1.00	0.00	-1.05	-0.71	0.33	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	1.00	0.00	1.15	2.10	4.29	16.25	0.75	30.75	0.75
7*10Y	2.00	0.00	2.20	2.81	3.96	9.50	2.00	16.75	2.00
10*12Y	2.25	-0.50	2.60	2.71	2.65	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	2.50	-0.50	3.10	3.41	3.75	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	0.50	-0.25	1.05	2.13	1.63	10.25	-1.50	28.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.751	0.00	1.780	1.823	1.819	1.935	1.751	2.130	1.237
1.5Y	1.744	0.10	1.775	1.832	1.832	2.113	1.743	2.145	1.232
2Y	1.722	0.70	1.755	1.827	1.827	2.230	1.715	2.230	1.225
3Y	1.690	1.50	1.722	1.788	1.798	2.315	1.675	2.315	1.200
4Y	1.742	1.70	1.773	1.847	1.864	2.502	1.725	2.502	1.232
5Y	1.706	0.90	1.744	1.837	1.862	2.602	1.697	2.602	1.217
7Y	1.797	1.80	1.827	1.928	1.961	2.728	1.779	2.728	1.270
10Y	1.830	2.50	1.855	1.954	1.978	2.815	1.805	2.815	1.355
20Y	1.861	2.10	1.884	1.996	2.025	2.792	1.840	2.970	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.90	0.00
CALL	1.82	6.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.69	-0.06	109.71	109.75	109.67
LKTb	128.87	-0.27	129.00	129.06	128.84

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	3.90	1.75	3.24	3.67	2.51	6.75	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	-1.65	1.40	-1.38	-0.01	-1.18	2.25	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-3.70	0.55	-3.39	-2.52	-3.42	-0.25	-17.00	-0.25	-25.15
3Y	-4.00	0.00	-3.77	-2.03	-3.53	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.45	-0.45	-10.93	-9.60	-11.10	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-8.60	0.60	-9.05	-9.45	-11.33	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-18.70	-0.30	-18.40	-19.28	-20.93	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-20.00	-1.00	-19.00	-19.03	-18.66	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-22.60	-0.85	-20.85	-21.09	-21.74	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1135.10 (-1.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-50.00	1.25	1Y	1.2900	3.00	1.6200	0.9950	1*2Y	-20.00	0.00		
-54.25	0.50	1.5Y	1.1850	2.00	1.6600	1.2350	2*3Y	-6.00	-0.50		
-59.50	1.75	2Y	1.0900	3.00	1.6950	1.3200	2*5Y	-16.50	-0.50		
-62.00	1.00	3Y	1.0300	2.50	1.7550	1.0050	3*4Y	-5.00	0.00		
-64.75	1.25	4Y	0.9800	2.50	1.8000	0.9550	3*5Y	-10.50	0.00		
-69.50	1.00	5Y	0.9250	2.50	1.8500	0.9000	4*5Y	-5.50	0.00		
-64.50	1.00	7Y	0.9650	2.50	1.8950	0.9400	5*7Y	4.00	0.00		
-47.50	-0.50	10Y	1.1550	1.00	2.0500	1.1450	5*10Y	23.00	-1.50		

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	2.2621	0.0322	2.2299	2.2060	2.2662	2.9773	1.6207	2.9773	0.4100
10Y	2.4059	0.0060	2.3999	2.3735	2.4203	3.2382	2.3156	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	54.01	2.52	51.49	46.10	47.62	103.03	-47.93	103.03	-160.00
10Y	57.59	-1.90	59.49	53.35	51.53	98.82	-24.13	98.82	-63.50

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-5.50	0.25	-5.75	-6.25	-4.25	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTb 2*10Y	10.80	1.80	9.00	9.50	11.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	14.38	-2.62	17.00	16.75	15.41	79.07	8.46	177.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	83								
01Y									
1.5Y	72.75								
02Y	68.25/68.5								
03Y	65								
04Y	63.25								
05Y	62/61								
		SPRD							
07Y									
10Y	63.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS		1y 29							
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			176 건	10	166	147	130	120	96
금 액			59,691 억원	6,376	53,315	59,065	42,518	41,176	18,420

장중동향
국고채 금리, 외인 10년 선물 매도세와 미국 국채 금리 상승에 연동한 조정 장세.

IRS, 금리 전 구간 상승.
2-5년 구간 위주의 거래.

CRS, 전체적인 금리 상승. 커브 플랫트닝.