

IPS Daily Morning Brief

2019-04-02

종가 기준일 2019-04-01

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8850	0.75	1.8765	1.8871	1.8700	1.9125	1.5525	2.1000	1.2875
9M	1.8450	1.50	1.8380	1.8736	1.8598	1.9125	1.6650	2.0800	1.2500
1Y	1.8100	2.00	1.8035	1.8565	1.8441	1.9200	1.7525	2.0650	1.2200
1.5Y	1.7500	2.25	1.7485	1.8259	1.8200	2.0250	1.7125	2.0825	1.1900
2Y	1.7100	2.50	1.7090	1.7956	1.7917	2.1150	1.6725	2.1150	1.1675
3Y	1.6775	2.75	1.6740	1.7610	1.7621	2.2225	1.6350	2.2225	1.1550
4Y	1.6550	2.75	1.6530	1.7439	1.7517	2.2950	1.6150	2.2950	1.1575
5Y	1.6475	2.75	1.6440	1.7351	1.7474	2.3400	1.6050	2.3400	1.1575
7Y	1.6375	2.75	1.6340	1.7273	1.7503	2.3950	1.5950	2.4000	1.1675
10Y	1.6575	2.75	1.6550	1.7544	1.7893	2.4850	1.6150	2.5275	1.2125
12Y	1.6800	2.75	1.6800	1.7813	1.8158	2.5225	1.6425	2.5775	1.2150
15Y	1.6800	2.50	1.6835	1.7878	1.8265	2.5400	1.6450	2.6325	1.2150
20Y	1.6550	2.00	1.6620	1.7739	1.8056	2.5600	1.6225	2.7900	1.2150

6*9M	-4.00	0.75	-3.85	-1.35	-1.02	11.50	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-3.50	0.50	-3.45	-1.71	-1.57	9.50	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-10.00	0.50	-9.45	-6.09	-5.24	23.00	-10.50	23.00	-10.50
2*3Y	-3.25	0.25	-3.50	-3.46	-2.96	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-5.50	0.25	-5.60	-5.18	-4.00	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-6.25	0.25	-6.50	-6.05	-4.43	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-2.25	0.00	-2.10	-1.71	-1.04	8.50	-2.50	11.25	-2.50
3*5Y	-3.00	0.00	-3.00	-2.59	-1.48	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-0.75	0.00	-0.90	-0.88	-0.43	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	-1.00	0.00	-1.00	-0.79	0.29	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	1.00	0.00	1.10	1.93	4.19	16.25	0.75	30.75	0.75
7*10Y	2.00	0.00	2.10	2.71	3.90	9.50	2.00	16.75	2.00
10*12Y	2.25	0.00	2.50	2.69	2.65	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	2.25	-0.25	2.85	3.34	3.72	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	-0.25	-0.75	0.70	1.95	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	1.754	0.30	1.768	1.819	1.819	1.935	1.751	2.130	1.237
1.5Y	1.750	0.60	1.762	1.826	1.831	2.113	1.743	2.145	1.232
2Y	1.750	2.80	1.744	1.821	1.826	2.230	1.715	2.230	1.225
3Y	1.727	3.70	1.713	1.782	1.797	2.315	1.675	2.315	1.200
4Y	1.777	3.50	1.764	1.841	1.862	2.502	1.725	2.502	1.232
5Y	1.747	4.10	1.735	1.829	1.860	2.602	1.697	2.602	1.217
7Y	1.834	3.70	1.820	1.919	1.959	2.728	1.779	2.728	1.270
10Y	1.865	3.50	1.849	1.946	1.976	2.815	1.805	2.815	1.355
20Y	1.897	3.60	1.881	1.985	2.024	2.792	1.840	2.925	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.90	0.00
CALL	1.74	-7.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.57	-0.12	109.65	109.66	109.57
LKTB	128.50	-0.37	128.74	128.79	128.50

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	5.60	1.70	3.53	3.77	2.54	6.75	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	0.00	1.65	-1.33	-0.02	-1.13	2.25	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-4.00	-0.30	-3.54	-2.58	-3.39	-0.25	-17.00	-0.25	-25.15
3Y	-4.95	-0.95	-3.92	-2.15	-3.48	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-12.20	-0.75	-11.12	-9.71	-11.03	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.95	-1.35	-9.14	-9.38	-11.21	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-19.65	-0.95	-18.60	-19.22	-20.85	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-20.75	-0.75	-19.40	-19.13	-18.68	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-24.20	-1.60	-21.94	-21.12	-21.82	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1133.70 (-1.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-52.00	-2.00	1Y	1.2900	0.00	1.6200	0.9950	1*2Y	-19.00	1.00		
-56.00	-1.75	1.5Y	1.1900	0.50	1.6600	1.2350	2*3Y	-5.50	0.50		
-61.00	-1.50	2Y	1.1000	1.00	1.6950	1.3200	2*5Y	-15.00	1.50		
-63.25	-1.25	3Y	1.0450	1.50	1.7550	1.0050	3*4Y	-4.50	0.50		
-65.50	-0.75	4Y	1.0000	2.00	1.8000	0.9550	3*5Y	-9.50	1.00		
-69.75	-0.25	5Y	0.9500	2.50	1.8500	0.9000	4*5Y	-5.00	0.50		
-64.75	-0.25	7Y	0.9900	2.50	1.8950	0.9400	5*7Y	4.00	0.00		
-48.75	-1.25	10Y	1.1700	1.50	2.0500	1.1450	5*10Y	22.00	-1.00		

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	2.3387	0.0766	2.2621	2.2299	2.2060	2.9773	1.6329	2.9773	0.4100
10Y	2.5009	0.0950	2.4059	2.3999	2.3735	3.2382	2.3166	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	58.87	4.86	54.01	51.49	46.10	103.03	-47.37	103.03	-160.00
10Y	63.59	6.00	57.59	59.49	53.35	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	-5.25	0.25	-5.50	-5.75	-6.25	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTb 2*10Y	11.50	0.70	10.80	9.00	9.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	16.22	1.84	14.38	17.00	16.75	79.07	8.46	177.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	81								
1.5Y									
02Y	70.25	SPRD	5y*10y 1						
03Y									
04Y									
05Y	65								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	80 건	-96	176	166	147	130	120	96	
금 액	21,895 억원	-37,796	59,691	53,315	59,065	42,518	41,176	18,420	

장중동향
국고채 금리, 되돌림 장세. 금리 상승.

IRS, 현물 금리에 연동되며 전 구간 금리 상승 마감.

CRS, 대부분 구간에서 금리 상승.
그동안 중장기 구간 금리 하락을 되돌리는 모습.