

IPS Daily Morning Brief

2019-04-04

종가 기준일 2019-04-03

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8700	-0.75	1.8760	1.8854	1.8705	1.9125	1.5650	2.1000	1.2875
9M	1.8400	0.25	1.8340	1.8688	1.8597	1.9125	1.6775	2.0800	1.2500
1Y	1.8050	0.50	1.7955	1.8488	1.8435	1.9200	1.7575	2.0650	1.2200
1.5Y	1.7500	1.75	1.7345	1.8135	1.8181	2.0250	1.7125	2.0825	1.1900
2Y	1.7075	1.75	1.6930	1.7820	1.7893	2.1150	1.6725	2.1150	1.1675
3Y	1.6800	1.75	1.6610	1.7478	1.7594	2.2225	1.6350	2.2225	1.1550
4Y	1.6650	2.50	1.6405	1.7299	1.7485	2.2950	1.6150	2.2950	1.1575
5Y	1.6625	2.75	1.6340	1.7211	1.7440	2.3400	1.6050	2.3400	1.1575
7Y	1.6625	3.50	1.6265	1.7129	1.7464	2.3950	1.5950	2.4000	1.1675
10Y	1.6825	3.50	1.6465	1.7386	1.7845	2.4850	1.6150	2.5275	1.2125
12Y	1.7050	3.50	1.6700	1.7650	1.8109	2.5225	1.6425	2.5775	1.2150
15Y	1.7050	3.50	1.6710	1.7708	1.8210	2.5400	1.6450	2.6325	1.2150
20Y	1.6750	3.25	1.6460	1.7546	1.8007	2.5600	1.6225	2.7900	1.2150

6*9M	-3.00	1.00	-4.20	-1.66	-1.08	11.50	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-3.50	0.25	-3.85	-2.00	-1.62	9.50	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-9.75	1.25	-10.25	-6.68	-5.43	23.00	-11.00	23.00	-11.00
2*3Y	-2.75	0.00	-3.20	-3.43	-2.98	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.25	0.75	-5.25	-5.21	-4.08	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-4.50	1.00	-5.90	-6.09	-4.52	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-1.50	0.75	-2.05	-1.79	-1.09	8.50	-2.50	11.25	-2.50
3*5Y	-1.75	1.00	-2.70	-2.66	-1.54	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-0.25	0.25	-0.65	-0.88	-0.45	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	0.00	0.75	-0.75	-0.83	0.23	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	2.00	0.75	1.25	1.75	4.04	16.25	0.75	30.75	0.75
7*10Y	2.00	0.00	2.00	2.58	3.81	9.50	2.00	16.75	2.00
10*12Y	2.25	0.00	2.35	2.64	2.65	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	2.25	0.00	2.45	3.21	3.66	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	-0.75	-0.25	-0.05	1.60	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	0.000	-174.60	1.751	1.813	1.819	1.935	1.746	2.130	1.237
1.5Y	0.000	-173.90	1.744	1.818	1.830	2.113	1.739	2.145	1.232
2Y	0.000	-172.70	1.729	1.812	1.824	2.230	1.715	2.230	1.225
3Y	0.000	-170.00	1.698	1.773	1.795	2.315	1.675	2.315	1.200
4Y	0.000	-175.50	1.750	1.831	1.859	2.502	1.725	2.502	1.232
5Y	0.000	-172.50	1.719	1.816	1.856	2.602	1.697	2.602	1.217
7Y	0.000	-181.60	1.807	1.905	1.955	2.728	1.779	2.728	1.270
10Y	0.000	-185.00	1.838	1.932	1.974	2.815	1.805	2.815	1.355
20Y	0.000	-189.00	1.872	1.970	2.023	2.792	1.840	2.925	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.87	-2.00
CALL	1.70	-5.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.57	-0.08	109.65	109.68	109.55
LKTb	128.28	-0.44	128.69	128.76	128.25

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	180.50	175.10	39.51	12.67	5.48	180.50	-9.65	180.50	-17.75
1.5Y	175.00	175.65	33.93	8.65	1.83	175.00	-15.60	175.00	-19.10
2Y	170.75	174.45	31.02	6.02	-0.44	170.75	-17.00	170.75	-25.15
3Y	168.00	171.75	30.26	6.33	-0.56	168.00	-13.50	168.00	-19.50
4Y	166.50	178.00	24.07	-1.00	-7.98	166.50	-25.00	166.50	-30.35
5Y	166.25	175.25	25.90	-0.37	-8.12	166.25	-27.25	166.25	-27.25
7Y	166.25	185.10	18.13	-9.72	-17.65	166.25	-35.15	166.25	-37.65
10Y	168.25	188.50	17.65	-9.72	-15.62	168.25	-37.50	168.25	-38.70
20Y	167.50	192.25	14.84	-11.70	-18.83	167.50	-29.60	167.50	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1134.30 (-2.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-49.00	2.00	1Y	1.3150	2.50	1.6200	0.9950	1*2Y	-17.50	1.00		
-52.50	1.25	1.5Y	1.2250	3.00	1.6600	1.2350	2*3Y	-5.00	0.50		
-56.75	1.75	2Y	1.1400	3.50	1.6950	1.3200	2*5Y	-13.50	1.00		
-59.00	2.25	3Y	1.0900	4.00	1.7550	1.0050	3*4Y	-4.00	0.00		
-61.50	1.50	4Y	1.0500	4.00	1.8000	0.9550	3*5Y	-8.50	0.50		
-65.75	1.75	5Y	1.0050	4.50	1.8500	0.9000	4*5Y	-4.50	0.50		
-61.75	1.00	7Y	1.0450	4.50	1.8950	0.9400	5*7Y	4.00	0.00		
-47.75	-1.00	10Y	1.2050	2.50	2.0500	1.1450	5*10Y	20.00	-2.00		

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	2.3389	0.0325	2.3064	2.3387	2.2621	2.9773	1.6414	2.9773	0.4100
10Y	2.5214	0.0490	2.4724	2.5009	2.4059	3.2382	2.3187	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	233.89	175.95	57.94	58.87	54.01	233.89	-47.37	233.89	-160.00
10Y	252.14	189.90	62.24	63.59	57.59	252.14	-24.13	252.14	-63.50

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-2.50	1.75	-4.25	-5.25	-5.50	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTb 2*10Y	0.00	-12.30	12.30	11.50	10.80	63.50	0.00	82.90	0.00
UST 2*10Y	18.25	1.65	16.60	16.22	14.38	79.07	8.46	177.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6y 65						
06M									
09M									
01Y	80.25								
1.5Y									
02Y	70/70.25	SPRD	2y*3y -2.5						
03Y	67.5								
04Y									
05Y	65.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y 06								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	121 건	12	109	80	176	166	147	130	
금 액	43,895 억원	11,878	32,017	21,895	59,691	53,315	59,065	42,518	

장중동향
국고채 금리, 외인이 국채선물을 대량 순매도한 가운데 미중 무역 합의 근접 소식 등 영향으로 금리 상승.

IRS, 대부분 구간에서 금리 상승.
짧은 구간은 오전 시중은행 CD가 민평 아래 금리로 발행되면서 오퍼리쉬한 모습을 보이며 금리 하락.
반면 중장기 구간은 미중 무역협상이 합의에 근접했다는 소식에 미 금리가 오르는데 동조하는 모습.

CRS, 전 구간 금리 상승.