IPS Daily Morning Brief

2019-04-08

종가 기준일 2019-04-05

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8600	0.25	1.8700	1.8826	1.8705	1.9125	1.5825	2.1000	1.2875
9M	1.8375	0.25	1.8390	1.8640	1.8594	1.9125	1.6900	2.0800	1.2500
1Y	1.8050	0.75	1.8035	1.8413	1.8427	1.9200	1.7575	2.0650	1.2200
1.5Y	1.7575	1.75	1.7460	1.8025	1.8162	2.0250	1.7125	2.0825	1.1900
2Y	1.7200	2.50	1.7045	1.7699	1.7868	2.1150	1.6725	2.1150	1.1675
3Y	1.6900	2.25	1.6755	1.7364	1.7567	2.2225	1.6350	2.2225	1.1550
4Y	1.6700	2.50	1.6550	1.7178	1.7450	2.2950	1.6150	2.2950	1.1575
5Y	1.6600	1.75	1.6495	1.7091	1.7402	2.3400	1.6050	2.3400	1.1575
7Y	1.6625	2.00	1.6465	1.7016	1.7423	2.3950	1.5950	2.4000	1.1675
10Y	1.6900	2.75	1.6680	1.7268	1.7798	2.4850	1.6150	2.5275	1.2125
12Y	1.7125	2.75	1.6905	1.7526	1.8061	2.5225	1.6425	2.5775	1.2150
15Y	1.7125	2.75	1.6905	1.7576	1.8157	2.5400	1.6450	2.6325	1.2150
20Y	1.6825	2.75	1.6620	1.7393	1.7958	2.5600	1.6225	2.7900	1.2150

6*9M	-2.25	0.00	-3.10	-1.86	-1.10	11.50	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-3.25	0.50	-3.55	-2.28	-1.67	9.50	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-8.50	1.75	-9.90	-7.14	-5.59	23.00	-11.00	23.00	-11.00
2*3Y	-3.00	-0.25	-2.90	-3.35	-3.02	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-5.00	0.00	-4.95	-5.21	-4.19	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-6.00	-0.75	-5.50	-6.08	-4.66	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-2.00	0.25	-2.05	-1.86	-1.17	8.50	-2.50	11.25	-2.50
3*5Y	-3.00	-0.50	-2.60	-2.73	-1.65	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-1.00	-0.75	-0.55	-0.86	-0.47	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	0.25	0.25	-0.30	-0.75	0.21	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	3.00	1.00	1.85	1.76	3.95	16.25	0.75	30.75	0.75
7*10Y	2.75	0.75	2.15	2.51	3.74	9.50	2.00	16.75	2.00
10*12Y	2.25	0.00	2.25	2.59	2.64	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	2.25	0.00	2.25	3.09	3.59	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	-0.75	0.00	-0.60	1.25	1.61	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.749	0.60	1.747	1.801	1.816	1.935	1.743	2.130	1.237
1.5Y	1.754	0.90	1.747	1.804	1.827	2.113	1.739	2.145	1.232
2Y	1.740	0.80	1.737	1.798	1.820	2.230	1.715	2.230	1.225
3Y	1.735	1.80	1.719	1.762	1.791	2.315	1.675	2.315	1.200
4Y	1.790	1.70	1.774	1.821	1.855	2.502	1.725	2.502	1.232
5Y	1.775	2.00	1.750	1.801	1.851	2.602	1.697	2.602	1.217
7Y	1.856	2.00	1.838	1.890	1.950	2.728	1.779	2.728	1.270
10Y	1.895	2.30	1.874	1.919	1.969	2.815	1.805	2.815	1.355
20Y	1.925	1.00	1.909	1.955	2.019	2.792	1.840	2.925	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	-1.00
CALL	1.75	3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.52	-0.07	109.57	109.58	109.51
LKTB	128.18	-0.26	128.40	128.40	128.16

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	0.15	5.65	4.06	2.62	6.75	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	0.35	0.85	-0.06	-0.19	-1.03	2.25	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-2.00	1.70	-3.23	-2.78	-3.29	-0.25	-17.00	-0.25	-25.15
3Y	-4.50	0.45	-4.37	-2.52	-3.46	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-12.00	0.80	-11.94	-10.31	-11.00	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-11.50	-0.25	-10.09	-9.21	-11.08	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-19.35	0.00	-19.11	-18.83	-20.72	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-20.50	0.45	-20.58	-19.26	-18.93	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-24.25	1.75	-24.68	-21.59	-22.27	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-48.50	-1.75
-52.25	-2.75
-55.00	-2.00
-57.00	-2.25
-57.50	-1.50
-60.50	-0.75
-56.75	-1.00
-45.00	-1.75

CRS

USD/KRW 1136.60 (+0.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3200	-1.00	1.6200	0.9950	1*2Y	-15.00	1.50
1.5Y	1.2350	-1.00	1.6600	1.2350	2*3Y	-5.00	-0.50
2Y	1.1700	0.50	1.6950	1.3200	2*5Y	-11.50	0.50
3Y	1.1200	0.00	1.7550	1.0050	3*4Y	-2.50	1.00
4Y	1.0950	1.00	1.8000	0.9550	3*5Y	-6.50	1.00
5Y	1.0550	1.00	1.8500	0.9000	4*5Y	-4.00	0.00
7Y	1.0950	1.00	1.8950	0.9400	5*7Y	4.00	0.00
10Y	1.2400	1.00	2.0500	1.1450	5*10Y	18.50	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	2.4330	0.0981	2.3349	2.3389	2.3064	2.9773	1.6834	2.9773	0.4100
10Y	2.4936	-0.0197	2.5133	2.5214	2.4724	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	69.30	9.01	60.29	60.39	57.94	103.03	-47.37	103.03	-160.00
10Y	59.86	-4.27	64.13	63.44	62.24	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	-3.00	0.25	-3.25	-2.50	-4.25	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTB 2*10Y	15.50	1.50	14.00	15.20	12.30	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	6.06	-11.78	17.84	18.25	16.60	79.07	6.06	177.00	6.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y		SPRD	9*12M -3.25
03Y	67.25		3*7Y -2.25
04Y	66.25		5*10Y 03 / 2.75
05Y	65.5		
07Y	65		
10Y	68		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y CCS 32		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	118 건	-18	136	121	109	80	176	166
금 액	67,211 억원	-465	67,676	43,895	32,017	21,895	59,691	53,315

장중동향

국고채 금리, 미중 무역 합의 기대와 함께 금리 상승 마감.

IRS, 전 구간 금리 상승.
오전 내내 관망세가 이어지다 오후 들어 국채선물이 하락하며 거래 이어져.

CRS, 2Y 이상 구간에서 금리 상승.