

IPS Daily Morning Brief

2019-04-12

종가 기준일 2019-04-11

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8575	-0.50	1.8595	1.8769	1.8710	1.9125	1.6000	2.1000	1.2875
9M	1.8450	-0.25	1.8410	1.8555	1.8595	1.9125	1.6900	2.0800	1.2500
1Y	1.8200	0.25	1.8100	1.8290	1.8420	1.9200	1.7575	2.0600	1.2200
1.5Y	1.7750	1.00	1.7590	1.7844	1.8137	2.0250	1.7125	2.0725	1.1900
2Y	1.7250	1.00	1.7145	1.7473	1.7828	2.1150	1.6725	2.1150	1.1675
3Y	1.6825	1.00	1.6775	1.7129	1.7519	2.2225	1.6350	2.2225	1.1550
4Y	1.6650	1.00	1.6590	1.6938	1.7393	2.2950	1.6150	2.2950	1.1575
5Y	1.6525	1.00	1.6475	1.6848	1.7338	2.3400	1.6050	2.3400	1.1575
7Y	1.6500	1.25	1.6470	1.6788	1.7354	2.3950	1.5950	2.3950	1.1675
10Y	1.6750	1.00	1.6725	1.7031	1.7715	2.4850	1.6150	2.4950	1.2125
12Y	1.7000	1.00	1.6960	1.7283	1.7978	2.5225	1.6425	2.5450	1.2150
15Y	1.7025	1.25	1.6965	1.7319	1.8064	2.5400	1.6450	2.5975	1.2150
20Y	1.6750	1.25	1.6675	1.7096	1.7875	2.5600	1.6225	2.7500	1.2150

6*9M	-1.25	0.25	-1.85	-2.14	-1.14	10.75	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-2.50	0.50	-3.10	-2.65	-1.75	9.25	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-9.50	0.75	-9.55	-8.18	-5.92	23.00	-11.00	23.00	-11.00
2*3Y	-4.25	0.00	-3.70	-3.44	-3.09	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-6.00	0.00	-5.55	-5.35	-4.35	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-7.25	0.00	-6.70	-6.25	-4.90	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-1.75	0.00	-1.85	-1.91	-1.26	8.50	-2.50	11.25	-2.50
3*5Y	-3.00	0.00	-3.00	-2.81	-1.80	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-1.25	0.00	-1.15	-0.90	-0.55	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	-0.25	0.25	-0.05	-0.60	0.15	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	2.25	0.00	2.50	1.84	3.77	16.25	0.75	30.75	0.75
7*10Y	2.50	-0.25	2.55	2.44	3.61	9.50	2.00	16.75	2.00
10*12Y	2.50	0.00	2.35	2.51	2.63	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	2.75	0.25	2.40	2.88	3.49	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	0.00	0.25	-0.50	0.65	1.60	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.766	0.10	1.758	1.788	1.814	1.935	1.743	2.130	1.237
1.5Y	1.761	0.10	1.755	1.788	1.822	2.113	1.739	2.140	1.232
2Y	1.742	0.00	1.740	1.778	1.814	2.230	1.715	2.230	1.225
3Y	1.731	0.20	1.729	1.747	1.787	2.315	1.675	2.315	1.200
4Y	1.780	0.30	1.779	1.803	1.849	2.502	1.725	2.502	1.232
5Y	1.762	0.00	1.763	1.782	1.844	2.602	1.697	2.602	1.217
7Y	1.836	0.30	1.839	1.866	1.941	2.728	1.779	2.728	1.270
10Y	1.872	0.50	1.875	1.897	1.962	2.815	1.805	2.815	1.355
20Y	1.895	-0.20	1.902	1.927	2.011	2.792	1.840	2.871	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.77	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.52	-0.02	109.57	109.57	109.52
LKTb	128.41	-0.06	128.63	128.64	128.41

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	5.40	0.15	5.16	4.15	2.83	6.75	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	1.40	0.90	0.42	-0.34	-0.79	2.25	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-1.70	1.00	-2.53	-3.12	-3.13	-0.25	-17.00	-0.25	-25.15
3Y	-4.85	0.80	-5.19	-3.41	-3.48	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.50	0.70	-12.04	-10.93	-10.97	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.95	1.00	-11.57	-9.68	-11.04	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-18.60	0.95	-19.18	-18.69	-20.56	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.70	0.50	-20.27	-19.41	-19.08	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-22.00	1.45	-23.41	-21.77	-22.39	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1139.40 (+0.80)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-54.00	-0.75	1Y	1.2800	-0.50	1.6200	0.9950	1*2Y	-19.00	0.00		
-59.50	-1.50	1.5Y	1.1800	-0.50	1.6600	1.2350	2*3Y	-5.00	0.00		
-63.50	-1.50	2Y	1.0900	-0.50	1.6950	1.3200	2*5Y	-12.00	0.00		
-64.25	-1.50	3Y	1.0400	-0.50	1.7550	1.0050	3*4Y	-2.50	0.00		
-65.00	-1.50	4Y	1.0150	-0.50	1.8000	0.9550	3*5Y	-7.00	0.00		
-68.25	-1.50	5Y	0.9700	-0.50	1.8500	0.9000	4*5Y	-4.50	0.00		
-64.00	-1.75	7Y	1.0100	-0.50	1.8950	0.9400	5*7Y	4.00	0.00		
-51.00	-1.50	10Y	1.1650	-0.50	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	2.3520	0.0369	2.3151	2.3517	2.3638	2.9773	1.7213	2.9773	0.4100
10Y	2.4979	0.0294	2.4685	2.5006	2.5302	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	61.00	3.69	57.31	61.67	62.38	103.03	-41.07	103.03	-159.50
10Y	62.59	2.44	60.15	63.36	65.52	98.82	-22.56	98.82	-63.50

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-5.00	0.00	-5.00	-4.00	-4.00	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTb 2*10Y	13.00	0.50	12.50	13.20	13.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	14.59	-0.75	15.34	14.89	16.64	79.07	6.06	177.00	6.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL												
IRS					ODD Tenor							
06M	86											
09M												
01Y												
1.5Y	76.75											
02Y	71.5				SPRD	1y*2y -10.25						
03Y	1.5y*5y -12.5											
04Y	2y*5y -7.25/-7.5											
05Y	3y*5y -3											
07Y												
10Y												
12Y												
15Y												
20Y												
CRS	4*5y CCS -4.5											
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6			
거래현황	106 건		-14	120	85	105	118	136	121			
금 액	33,155 억원		-24,310	57,465	41,816	29,803	67,211	67,676	43,895			

장중동향
국고채 금리, 미 FOMC 의사록과 ECB 등 대형 이벤트를 소화하며 보합세 마감.

IRS, 대부분 구간에서 금리 상승.
장중 내내 비디쉬한 모습. 오후들어 국채선물 하락에 연동되며 금리 상승. 커브 스티프닝.

CRS, 전 구간에서 금리 하락.