IPS Daily Morning Brief

2019-04-16

종가 기준일 2019-04-15

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8600	0.75	1.8580	1.8729	1.8709	1.9125	1.6000	2.1000	1.2875
9M	1.8550	1.00	1.8460	1.8514	1.8595	1.9125	1.6900	2.0800	1.2500
1Y	1.8400	1.75	1.8210	1.8243	1.8417	1.9200	1.7575	2.0575	1.2200
1.5Y	1.8050	2.75	1.7745	1.7778	1.8125	2.0250	1.7125	2.0725	1.1900
2Y	1.7625	3.25	1.7275	1.7383	1.7805	2.1150	1.6725	2.1150	1.1675
3Y	1.7250	3.75	1.6870	1.7029	1.7489	2.2225	1.6350	2.2225	1.1550
4Y	1.7075	4.00	1.6690	1.6831	1.7359	2.2950	1.6150	2.2950	1.1575
5Y	1.7000	4.00	1.6590	1.6741	1.7301	2.3400	1.6050	2.3400	1.1575
7Y	1.6975	4.25	1.6560	1.6684	1.7312	2.3950	1.5950	2.3950	1.1675
10Y	1.7225	4.25	1.6815	1.6923	1.7665	2.4850	1.6150	2.4925	1.2125
12Y	1.7475	4.25	1.7060	1.7171	1.7928	2.5225	1.6425	2.5425	1.2150
15Y	1.7500	4.25	1.7075	1.7203	1.8010	2.5400	1.6450	2.5950	1.2150
20Y	1.7225	4.25	1.6795	1.6964	1.7827	2.5600	1.6225	2.7475	1.2150

6*9M	-0.50	0.25	-1.20	-2.15	-1.14	10.25	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.50	0.75	-2.50	-2.71	-1.78	8.75	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-7.75	1.50	-9.35	-8.60	-6.11	23.00	-11.00	23.00	-11.00
2*3Y	-3.75	0.50	-4.05	-3.54	-3.17	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-5.50	0.75	-5.85	-5.51	-4.46	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-6.25	0.75	-6.85	-6.41	-5.04	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-1.75	0.25	-1.80	-1.98	-1.30	8.50	-2.50	11.25	-2.50
3*5Y	-2.50	0.25	-2.80	-2.88	-1.88	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-0.75	0.00	-1.00	-0.90	-0.58	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	-0.25	0.25	-0.30	-0.58	0.10	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	2.25	0.25	2.25	1.81	3.64	16.25	0.75	30.75	0.75
7*10Y	2.50	0.00	2.55	2.39	3.53	9.50	2.00	16.75	2.00
10*12Y	2.50	0.00	2.45	2.49	2.63	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	2.75	0.00	2.60	2.80	3.45	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	0.00	0.00	-0.20	0.41	1.62	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.777	0.90	1.767	1.782	1.812	1.935	1.743	2.130	1.237
1.5Y	1.781	1.90	1.763	1.781	1.819	2.113	1.739	2.140	1.232
2Y	1.766	2.40	1.745	1.769	1.811	2.230	1.715	2.230	1.225
3Y	1.760	3.00	1.734	1.741	1.784	2.315	1.675	2.315	1.200
4Y	1.812	3.00	1.784	1.795	1.846	2.502	1.725	2.502	1.232
5Y	1.802	3.20	1.770	1.773	1.841	2.602	1.697	2.602	1.217
7Y	1.883	3.70	1.846	1.856	1.936	2.728	1.779	2.728	1.270
10Y	1.925	4.00	1.883	1.888	1.958	2.815	1.805	2.815	1.355
20Y	1.930	3.00	1.902	1.915	2.007	2.792	1.840	2.851	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.76	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.41	-0.11	109.43	109.44	109.40
LKTB	127.86	-0.45	127.92	127.98	127.83

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	6.30	0.85	5.44	4.27	2.94	6.75	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	2.40	0.85	1.17	-0.32	-0.69	2.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-0.35	0.85	-1.79	-3.09	-3.09	-0.25	-17.00	-0.25	-25.15
3Y	-3.50	0.75	-4.74	-3.81	-3.54	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.45	1.00	-11.52	-11.18	-11.00	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.20	0.80	-11.12	-9.91	-11.04	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-18.55	0.55	-18.98	-18.73	-20.51	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-20.25	0.25	-20.17	-19.61	-19.19	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-20.75	1.25	-22.27	-21.84	-22.39	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-56.50	-1.25
-63.00	-3.25
-67.25	-3.75
-68.00	-4.25
-67.75	-3.50
-70.50	-2.50
-66.75	-2.75
-53.75	-2.75

CRS

USD/KRW 1133.10 (-6.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2750	0.50	1.6000	0.9950	1*2Y	-18.50	-1.00
1.5Y	1.1750	-0.50	1.6300	1.2350	2*3Y	-4.50	0.00
2Y	1.0900	-0.50	1.6600	1.3200	2*5Y	-9.50	2.00
3Y	1.0450	-0.50	1.7150	1.0050	3*4Y	-1.50	1.00
4Y	1.0300	0.50	1.7550	0.9550	3*5Y	-5.00	2.00
5Y	0.9950	1.50	1.8000	0.9000	4*5Y	-3.50	1.00
7Y	1.0300	1.50	1.8950	0.9400	5*7Y	3.50	0.00
10Y	1.1850	1.50	2.0500	1.1450	5*10Y	19.00	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	2.3977	0.0001	2.3976	2.3520	2.3151	2.9773	1.7308	2.9773	0.4100
10Y	2.5520	-0.0168	2.5688	2.4979	2.4685	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	63.17	-2.39	65.56	61.00	57.31	103.03	-38.42	103.03	-159.50
10Y	62.70	-5.68	68.38	62.59	60.15	98.82	-22.13	98.82	-63.50

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-4.00	1.00	-5.00	-5.00	-5.00	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTB 2*10Y	15.90	1.60	14.30	13.00	12.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	15.43	-1.69	17.12	14.59	15.34	79.07	6.06	177.00	6.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	
06M	86		
09M	85.25		
01Y	84		
1.5Y			
02Y	76.25 / 76	SPRD	6*9M -0.75
03Y	71.5 / 72.5		1*2Y -7.5
04Y	70.25		2*5Y -6.25
05Y	68.75 / 69.75		
07Y			
10Y	72		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2y CCS 8.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	84 건	-6	90	106	120	85	105	118
금 액	32,765 억원	-12,591	45,356	33,155	57,465	41,816	29,803	67,211

장중동향

국고채 금리, 외인 선물 매도세에 금리 상승 마감.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.
비디쉬한 장세에 테이큰되며 거래.

CRS, 1.5-3Y을 제외한 구간에서 금리 상승.