

IPS Daily Morning Brief

2019-04-25

종가 기준일 2019-04-24

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8450	-0.25	1.8515	1.8611	1.8708	1.9125	1.6750	2.0875	1.2875
9M	1.8275	-0.50	1.8345	1.8393	1.8585	1.9125	1.7200	2.0525	1.2500
1Y	1.8100	-0.50	1.8180	1.8128	1.8405	1.9200	1.7575	2.0325	1.2200
1.5Y	1.7800	-1.00	1.7890	1.7676	1.8093	2.0250	1.7125	2.0325	1.1900
2Y	1.7425	-1.75	1.7565	1.7274	1.7762	2.1150	1.6725	2.1150	1.1675
3Y	1.7125	-1.50	1.7220	1.6929	1.7432	2.2225	1.6350	2.2225	1.1550
4Y	1.7000	-1.25	1.7045	1.6743	1.7288	2.2950	1.6150	2.2950	1.1575
5Y	1.6950	-1.25	1.6995	1.6670	1.7221	2.3400	1.6050	2.3400	1.1575
7Y	1.6950	-1.00	1.6990	1.6645	1.7220	2.3950	1.5950	2.3950	1.1675
10Y	1.7200	-1.00	1.7220	1.6878	1.7544	2.4850	1.6150	2.4850	1.2125
12Y	1.7450	-1.00	1.7470	1.7119	1.7804	2.5225	1.6425	2.5225	1.2150
15Y	1.7525	-1.00	1.7530	1.7143	1.7877	2.5400	1.6450	2.5400	1.2150
20Y	1.7275	-1.00	1.7270	1.6873	1.7707	2.5600	1.6225	2.6500	1.2150

6*9M	-1.75	-0.25	-1.70	-2.19	-1.24	8.50	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.75	0.00	-1.65	-2.65	-1.80	8.25	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-6.75	-1.25	-6.15	-8.54	-6.43	23.00	-11.00	23.00	-11.00
2*3Y	-3.00	0.25	-3.45	-3.45	-3.30	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.25	0.50	-5.20	-5.31	-4.74	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-4.75	0.50	-5.70	-6.04	-5.40	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-1.25	0.25	-1.75	-1.86	-1.44	8.50	-2.50	11.25	-2.50
3*5Y	-1.75	0.25	-2.25	-2.59	-2.11	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-0.50	0.00	-0.50	-0.72	-0.67	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	0.00	0.25	-0.05	-0.25	-0.02	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	2.50	0.25	2.25	2.08	3.23	16.25	0.75	30.75	0.75
7*10Y	2.50	0.00	2.30	2.33	3.25	9.50	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.50	0.00	2.50	2.41	2.60	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.25	0.00	3.10	2.65	3.33	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	0.75	0.00	0.50	-0.05	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	1.769	-0.40	1.770	1.762	1.807	1.935	1.743	2.025	1.237
1.5Y	1.774	-0.50	1.773	1.761	1.812	2.113	1.739	2.113	1.232
2Y	1.762	-1.30	1.769	1.749	1.804	2.230	1.715	2.230	1.225
3Y	1.747	-1.80	1.757	1.734	1.778	2.315	1.675	2.315	1.200
4Y	1.807	-1.30	1.812	1.787	1.838	2.502	1.725	2.502	1.232
5Y	1.795	-1.20	1.799	1.770	1.831	2.602	1.697	2.602	1.217
7Y	1.874	-1.10	1.877	1.850	1.923	2.728	1.779	2.728	1.270
10Y	1.912	-1.00	1.914	1.887	1.948	2.815	1.805	2.815	1.355
20Y	1.932	-0.50	1.930	1.911	1.992	2.792	1.840	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.85	0.00
CALL	1.73	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.42	0.05	109.40	109.45	109.36
LKTB	127.99	0.11	127.96	128.09	127.79

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	4.10	-0.10	4.78	5.11	3.39	6.75	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	0.60	-0.50	1.60	0.68	-0.27	2.65	-12.55	2.65	-19.10
2Y	-1.95	-0.45	-1.25	-2.16	-2.82	-0.25	-15.70	-0.25	-25.15
3Y	-3.45	0.30	-3.52	-4.12	-3.49	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.70	0.05	-10.79	-11.29	-10.94	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.00	-0.05	-9.97	-10.26	-10.89	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.90	0.10	-17.76	-18.56	-20.08	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.20	0.00	-19.22	-19.93	-19.35	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-20.45	-0.50	-20.26	-22.33	-22.09	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW 1150.90 (+9.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-59.00	-2.50	1Y	1.2200	-3.00	1.5000	0.9950	1*2Y	-15.50	0.50
-63.50	-1.00	1.5Y	1.1450	-2.00	1.5250	1.2350	2*3Y	-7.00	-0.50
-67.75	-0.75	2Y	1.0650	-2.50	1.5650	1.3200	2*5Y	-12.00	-0.50
-71.75	-1.50	3Y	0.9950	-3.00	1.6550	0.9950	3*4Y	-1.50	0.00
-72.00	-1.75	4Y	0.9800	-3.00	1.7200	0.9550	3*5Y	-5.00	0.00
-75.00	-1.75	5Y	0.9450	-3.00	1.7800	0.9000	4*5Y	-3.50	0.00
-71.00	-2.00	7Y	0.9850	-3.00	1.8950	0.9400	5*7Y	4.00	0.00
-58.50	-2.50	10Y	1.1350	-3.50	2.0500	1.1350	5*10Y	19.00	-0.50

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	2.3098	-0.0562	2.3660	2.3991	2.3900	2.9773	1.7620	2.9773	0.4100
10Y	2.5248	-0.0442	2.5690	2.5898	2.5637	3.2382	2.3394	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	54.78	-4.32	59.10	61.81	62.00	103.03	-26.17	103.03	-159.50
10Y	61.28	-3.42	64.70	65.48	65.37	98.82	-15.23	98.82	-63.50

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-2.25	0.75	-3.00	-2.75	-4.50	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTb 2*10Y	15.00	0.30	14.70	15.40	14.00	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	21.50	1.20	20.30	19.07	17.37	79.07	6.06	177.00	6.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	75.75/74	SPRD	1.5y*2y -3.5						
03Y	71.5		2y*5y -4.75/-5						
04Y			2y*5y*10y -7						
05Y	71/70.75		5y*6y 0						
07Y			5y*10y 2.25						
10Y	71.5/72								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y 7.5/7 3y 0								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	95 건	14	81	57	92	150	157	57	
금 액	30,413 억원	5,788	24,625	13,053	29,316	60,826	74,370	18,510	

장중동향

국고채 금리, 호주 물가지표 부진에 하락.

추경 예산이 발표됐지만, 시장에 미치는 영향은 제한적.

IRS, 전반적으로 선물에 연동하여 전 구간에서 하락.

뚜렷한 방향이 없는 가운데 양방향 호가가 많았음.

CRS, 전 구간 하락.