IPS Daily Morning Brief

2019-04-29

종가 기준일 2019-04-26

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8300	-0.75	1.8425	1.8571	1.8702	1.9125	1.6750	2.0875	1.2875
9M	1.8000	-1.00	1.8210	1.8374	1.8570	1.9125	1.7350	2.0525	1.2500
1Y	1.7750	-1.50	1.8020	1.8129	1.8388	1.9200	1.7575	2.0325	1.2200
1.5Y	1.7400	-1.75	1.7725	1.7705	1.8071	2.0250	1.7125	2.0325	1.1900
2Y	1.7025	-1.25	1.7375	1.7304	1.7736	2.1150	1.6725	2.1150	1.1675
3Y	1.6725	-1.25	1.7065	1.6965	1.7406	2.2225	1.6350	2.2225	1.1550
4Y	1.6625	-0.75	1.6930	1.6788	1.7259	2.2950	1.6150	2.2950	1.1575
5Y	1.6575	-0.75	1.6880	1.6719	1.7191	2.3400	1.6050	2.3400	1.1575
7Y	1.6550	-0.50	1.6860	1.6700	1.7185	2.3950	1.5950	2.3950	1.1675
10Y	1.6850	-0.25	1.7125	1.6941	1.7503	2.4850	1.6150	2.4850	1.2125
12Y	1.7100	-0.25	1.7375	1.7183	1.7763	2.5225	1.6425	2.5225	1.2150
15Y	1.7175	-0.25	1.7445	1.7211	1.7833	2.5400	1.6450	2.5400	1.2150
20Y	1.6950	0.00	1.7200	1.6939	1.7661	2.5600	1.6225	2.6500	1.2150

6*9M	-3.00	-0.25	-2.15	-1.98	-1.32	8.50	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-2.50	-0.50	-1.90	-2.45	-1.82	8.25	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-7.25	0.25	-6.45	-8.25	-6.52	23.00	-11.00	23.00	-11.00
2*3Y	-3.00	0.00	-3.10	-3.39	-3.30	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.00	0.50	-4.45	-5.16	-4.77	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-4.50	0.50	-4.95	-5.85	-5.45	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-1.00	0.50	-1.35	-1.78	-1.47	8.50	-2.50	11.25	-2.50
3*5Y	-1.50	0.50	-1.85	-2.46	-2.15	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-0.50	0.00	-0.50	-0.69	-0.68	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	-0.25	0.25	-0.20	-0.19	-0.06	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	2.75	0.50	2.45	2.23	3.12	16.25	0.75	30.75	0.75
7*10Y	3.00	0.25	2.65	2.41	3.18	9.50	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.50	0.00	2.50	2.41	2.59	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.25	0.00	3.20	2.70	3.30	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	1.00	0.25	0.75	-0.02	1.58	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.755	-0.30	1.766	1.762	1.804	1.935	1.743	2.020	1.237
1.5Y	1.756	-0.10	1.769	1.762	1.810	2.113	1.739	2.113	1.232
2Y	1.740	-0.60	1.761	1.751	1.802	2.230	1.715	2.230	1.225
3Y	1.720	-0.50	1.746	1.738	1.775	2.315	1.675	2.315	1.200
4Y	1.767	-0.80	1.800	1.791	1.835	2.502	1.725	2.502	1.232
5Y	1.752	-0.80	1.786	1.775	1.827	2.602	1.697	2.602	1.217
7Y	1.836	-0.50	1.866	1.855	1.918	2.728	1.779	2.728	1.270
10Y	1.875	-0.20	1.904	1.893	1.944	2.815	1.805	2.815	1.355
20Y	1.900	-1.20	1.926	1.916	1.987	2.792	1.840	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.84	-1.00
CALL	1.73	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.53	0.03	109.50	109.56	109.49
LKTB	128.36	0.01	128.35	128.54	128.31

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	2.00	-1.20	3.62	5.07	3.44	6.75	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	-1.60	-1.65	0.33	0.84	-0.25	2.65	-12.55	2.65	-19.10
2Y	-3.75	-0.65	-2.33	-2.11	-2.79	-0.25	-15.70	-0.25	-25.15
3Y	-4.75	-0.75	-3.93	-4.16	-3.47	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.45	0.05	-10.68	-11.21	-10.88	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.45	0.05	-9.82	-10.31	-10.77	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-18.10	0.00	-18.04	-18.52	-19.94	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.00	-0.05	-19.17	-19.87	-19.38	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-20.50	1.20	-20.56	-22.22	-22.09	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-60.50	2.50
-64.00	2.75
-66.25	2.75
-69.25	3.25
-68.75	2.75
-71.25	2.75
-67.00	2.50
-55.50	2.25

CRS

USD/KRW 1161.00 (+0.50)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.1700	1.00	1.5000	0.9950	1*2Y	-13.00	0.50
1.5Y	1.1000	1.00	1.5250	1.2350	2*3Y	-6.00	0.50
2Y	1.0400	1.50	1.5650	1.3200	2*5Y	-9.50	0.50
3Y	0.9800	2.00	1.6550	0.9600	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	0.9750	2.00	1.7200	0.9550	3*5Y	-3.50	0.00
5Y	0.9450	2.00	1.7800	0.9000	4*5Y	-3.00	0.00
7Y	0.9850	2.00	1.8950	0.9400	5*7Y	4.00	0.00
10Y	1.1300	2.00	2.0500	1.1100	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	2.2861	-0.0558	2.3419	2.3098	2.3660	2.9773	1.7783	2.9773	0.4100
10Y	2.5004	-0.0352	2.5356	2.5248	2.5690	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	54.61	-4.98	59.59	54.78	59.10	103.03	-26.17	103.03	-159.50
10Y	62.54	-3.32	65.86	61.28	64.70	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	-1.75	1.00	-2.75	-2.25	-3.00	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTB 2*10Y	13.50	0.40	13.10	15.00	14.70	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	21.43	2.06	19.37	21.50	20.30	79.07	6.06	177.00	6.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	78/77.75/77.5		
1.5Y	74.25		
02Y	70/70.25/70.5	SPRD	9y*10y 1
03Y			
04Y			
05Y	65.25/66		
07Y			
10Y	67.75/68.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y 15/16/15.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	110 건	14	96	95	81	57	92	150
금 액	47,087 억원	12,267	34,820	30,413	24,625	13,053	29,316	60,826

장중동향

국고채 금리, 소폭 하락.
전일 발표된 성장률 여파가 남았지만, 미국 GDP 발표를 대기하는 분위기.

IRS, 전 구간 하락. 커브 스티프닝.
장기보다 2년, 3년 등 짧은 구간 중심 거래.

CRS, 전 구간 상승