IPS Daily Morning Brief

2019-04-17

종가 기준일 2019-04-16

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8600	0.00	1.8585	1.8711	1.8711	1.9125	1.6075	2.1000	1.2875
9M	1.8550	0.00	1.8495	1.8496	1.8598	1.9125	1.6900	2.0775	1.2500
1Y	1.8400	0.00	1.8280	1.8224	1.8418	1.9200	1.7575	2.0550	1.2200
1.5Y	1.8075	0.25	1.7860	1.7754	1.8123	2.0250	1.7125	2.0675	1.1900
2Y	1.7675	0.50	1.7400	1.7350	1.7801	2.1150	1.6725	2.1150	1.1675
3Y	1.7325	0.75	1.7000	1.6995	1.7483	2.2225	1.6350	2.2225	1.1550
4Y	1.7175	1.00	1.6825	1.6798	1.7351	2.2950	1.6150	2.2950	1.1575
5Y	1.7100	1.00	1.6730	1.6709	1.7292	2.3400	1.6050	2.3400	1.1575
7Y	1.7100	1.25	1.6700	1.6655	1.7300	2.3950	1.5950	2.3950	1.1675
10Y	1.7350	1.25	1.6955	1.6891	1.7650	2.4850	1.6150	2.4850	1.2125
12Y	1.7600	1.25	1.7205	1.7139	1.7913	2.5225	1.6425	2.5325	1.2150
15Y	1.7625	1.25	1.7225	1.7168	1.7992	2.5400	1.6450	2.5825	1.2150
20Y	1.7350	1.25	1.6950	1.6921	1.7812	2.5600	1.6225	2.7350	1.2150

6*9M	-0.50	0.00	-0.90	-2.15	-1.14	10.00	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.50	0.00	-2.15	-2.73	-1.79	8.75	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-7.25	0.50	-8.80	-8.74	-6.17	23.00	-11.00	23.00	-11.00
2*3Y	-3.50	0.25	-4.00	-3.55	-3.18	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-5.00	0.50	-5.75	-5.53	-4.50	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-5.75	0.50	-6.70	-6.41	-5.10	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-1.50	0.25	-1.75	-1.98	-1.32	8.50	-2.50	11.25	-2.50
3*5Y	-2.25	0.25	-2.70	-2.86	-1.91	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-0.75	0.00	-0.95	-0.89	-0.60	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	0.00	0.25	-0.30	-0.54	0.09	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	2.50	0.25	2.25	1.83	3.58	16.25	0.75	30.75	0.75
7*10Y	2.50	0.00	2.55	2.36	3.50	9.50	2.00	16.75	2.00
10*12Y	2.50	0.00	2.50	2.48	2.63	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	2.75	0.00	2.70	2.76	3.42	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	0.00	0.00	-0.05	0.30	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	0.00	1.771	1.779	1.812	1.935	1.743	2.115	1.237
1.5Y	1.781	0.00	1.769	1.778	1.819	2.113	1.739	2.115	1.232
2Y	1.770	0.40	1.752	1.765	1.811	2.230	1.715	2.230	1.225
3Y	1.762	0.20	1.742	1.739	1.784	2.315	1.675	2.315	1.200
4Y	1.815	0.30	1.793	1.792	1.845	2.502	1.725	2.502	1.232
5Y	1.807	0.50	1.781	1.771	1.839	2.602	1.697	2.602	1.217
7Y	1.889	0.60	1.857	1.853	1.935	2.728	1.779	2.728	1.270
10Y	1.932	0.70	1.896	1.886	1.957	2.815	1.805	2.815	1.355
20Y	1.945	1.50	1.913	1.911	2.005	2.792	1.840	2.851	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.76	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.39	-0.02	109.42	109.46	109.39
LKTB	127.79	-0.07	127.90	128.09	127.74

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	0.00	5.74	4.35	3.01	6.75	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	2.65	0.25	1.70	-0.26	-0.63	2.65	-15.60	2.65	-19.10
2Y	-0.25	0.10	-1.24	-3.04	-3.05	-0.25	-15.70	-0.25	-25.15
3Y	-2.95	0.55	-4.24	-3.93	-3.54	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-9.75	0.70	-11.07	-11.22	-10.99	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.70	0.50	-10.76	-9.97	-11.03	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.90	0.65	-18.74	-18.70	-20.47	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.70	0.55	-20.07	-19.68	-19.24	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-21.00	-0.25	-21.84	-21.84	-22.37	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-55.50	1.00
-61.75	1.25
-66.25	1.00
-67.75	0.25
-67.75	0.00
-70.50	0.00
-67.00	-0.25
-54.00	-0.25

CRS

USD/KRW 1135.70 (+2.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2850	1.00	1.5900	0.9950	1*2Y	-18.00	0.50
1.5Y	1.1900	1.50	1.6150	1.2350	2*3Y	-5.00	-0.50
2Y	1.1050	1.50	1.6300	1.3200	2*5Y	-10.00	-0.50
3Y	1.0550	1.00	1.6800	1.0050	3*4Y	-1.50	0.00
4Y	1.0400	1.00	1.7200	0.9550	3*5Y	-5.00	0.00
5Y	1.0050	1.00	1.7800	0.9000	4*5Y	-3.50	0.00
7Y	1.0400	1.00	1.8950	0.9400	5*7Y	3.50	0.00
10Y	1.1950	1.00	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	2.4062	0.0085	2.3977	2.3976	2.3520	2.9773	1.7308	2.9773	0.4100
10Y	2.5935	0.0415	2.5520	2.5688	2.4979	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	63.62	0.45	63.17	65.56	61.00	103.03	-38.42	103.03	-159.50
10Y	66.15	3.45	62.70	68.38	62.59	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	-3.25	0.75	-4.00	-5.00	-5.00	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTB 2*10Y	16.20	0.30	15.90	14.30	13.00	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	18.73	3.30	15.43	17.12	14.59	79.07	6.06	177.00	6.06

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	84		
1.5Y			
02Y	76.25/76.75	SPRD	
03Y			
04Y			
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y	74.25		
20Y			
CRS	3y ccs 5.5		

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	57 건	-27	84	90	106	120	85	105
금 액	18,510 억원	-14,255	32,765	45,356	33,155	57,465	41,816	29,803

장중동향

국고채 금리, 금리 상승. RBA 의사록 영향 하락 후 상승 마감.

IRS, 전 구간 약보합세. 장 초반 도비쉬한 RBA 의사록 영향으로 하락.
증시 강세와 금통위 대기 부담으로 상승 전환.

CRS, 전 구간 상승.