IPS Daily Morning Brief

2019-03-27

종가 기준일 2019-03-26

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8775	-0.75	1.8885	1.8886	1.8700	1.9125	1.5525	2.1175	1.2875
9M	1.8575	-1.25	1.8775	1.8824	1.8613	1.9125	1.6650	2.1050	1.2500
1Y	1.8350	-1.75	1.8620	1.8709	1.8464	1.9200	1.7525	2.0925	1.2200
1.5Y	1.7950	-1.75	1.8305	1.8475	1.8245	2.0250	1.7700	2.1125	1.1900
2Y	1.7575	-1.50	1.7975	1.8189	1.7963	2.1150	1.7325	2.1350	1.1675
3Y	1.7225	-0.75	1.7600	1.7849	1.7669	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7075	0.00	1.7400	1.7699	1.7576	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.6975	0.25	1.7295	1.7620	1.7535	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.6900	0.75	1.7200	1.7568	1.7581	2.3950	1.6825	2.4525	1.1675
10Y	1.7150	0.75	1.7460	1.7879	1.7993	2.4850	1.7075	2.5950	1.2125
12Y	1.7425	0.75	1.7735	1.8154	1.8256	2.5225	1.7350	2.6450	1.2150
15Y	1.7500	0.75	1.7810	1.8234	1.8375	2.5400	1.7425	2.7050	1.2150
20Y	1.7300	0.75	1.7630	1.8129	1.8152	2.5600	1.7225	2.8725	1.2150

6*9M	-2.00	-0.50	-1.10	-0.63	-0.87	11.75	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-2.25	-0.50	-1.55	-1.15	-1.49	9.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-7.75	0.25	-6.45	-5.20	-5.01	23.00	-8.00	23.00	-8.00
2*3Y	-3.50	0.75	-3.75	-3.40	-2.94	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-5.00	1.50	-5.75	-4.90	-3.87	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-6.00	1.75	-6.80	-5.69	-4.28	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-1.50	0.75	-2.00	-1.50	-0.93	8.50	-2.25	11.25	-2.25
3*5Y	-2.50	1.00	-3.05	-2.29	-1.34	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-1.00	0.25	-1.05	-0.79	-0.41	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	-0.75	0.50	-0.95	-0.53	0.46	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	1.75	0.50	1.65	2.59	4.58	16.25	1.25	30.75	1.25
7*10Y	2.50	0.00	2.60	3.11	4.12	9.50	2.50	16.75	2.50
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.75	2.63	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.50	3.55	3.82	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	1.50	0.00	1.70	2.50	1.59	10.25	-1.50	28.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.801	-1.00	1.838	1.834	1.820	1.935	1.757	2.130	1.237
1.5Y	1.800	-1.50	1.845	1.846	1.836	2.113	1.800	2.145	1.232
2Y	1.790	-1.50	1.841	1.844	1.831	2.230	1.790	2.230	1.225
3Y	1.760	-1.20	1.787	1.805	1.804	2.315	1.760	2.315	1.200
4Y	1.818	-0.20	1.845	1.866	1.870	2.502	1.818	2.502	1.232
5Y	1.790	0.00	1.820	1.861	1.870	2.602	1.790	2.602	1.217
7Y	1.874	0.50	1.903	1.954	1.969	2.728	1.869	2.728	1.270
10Y	1.905	1.00	1.930	1.977	1.985	2.815	1.895	2.815	1.355
20Y	1.932	2.20	1.946	2.026	2.031	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.90	0.00
CALL	1.76	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.45	0.03	109.46	109.48	109.43
LKTB	128.06	-0.11	128.24	128.30	128.04

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	3.40	-0.75	2.36	3.68	2.64	6.75	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	-0.50	-0.25	-1.43	0.14	-1.13	2.25	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-3.25	0.00	-4.33	-2.52	-3.47	-0.25	-17.00	-0.25	-25.15
3Y	-3.75	0.45	-2.72	-2.03	-3.66	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.05	0.20	-10.48	-9.62	-11.24	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.25	0.25	-9.03	-9.93	-11.62	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-18.40	0.25	-18.28	-19.71	-21.11	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.00	-0.25	-18.42	-18.95	-18.54	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-20.20	-1.45	-18.32	-21.34	-21.59	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-56.00	2.25
-62.00	2.25
-66.25	2.00
-67.25	1.25
-68.75	0.00
-71.25	-0.25
-67.00	-0.25
-54.00	0.25

CRS

USD/KRW 1133.40 (-0.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2750	0.50	1.6200	0.9950	1*2Y	-18.00	0.00
1.5Y	1.1750	0.50	1.6600	1.2350	2*3Y	-4.50	0.00
2Y	1.0950	0.50	1.6950	1.3200	2*5Y	-11.00	-0.50
3Y	1.0500	0.50	1.7550	1.0450	3*4Y	-3.00	-0.50
4Y	1.0200	0.00	1.8000	1.0200	3*5Y	-6.50	-0.50
5Y	0.9850	0.00	1.8500	0.9850	4*5Y	-3.50	0.00
7Y	1.0200	0.50	1.8950	1.0150	5*7Y	3.50	0.50
10Y	1.1750	1.00	2.0500	1.1650	5*10Y	19.00	1.00

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	2.2662	0.0370	2.2292	2.3290	2.4167	2.9773	1.6125	2.9773	0.4100
10Y	2.4203	0.0237	2.3966	2.4417	2.5334	3.2382	2.3156	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	47.62	5.2	42.42	49.40	58.67	103.03	-48.25	103.03	-160.00
10Y	51.53	1.37	50.16	50.97	60.14	98.82	-24.13	98.82	-63.50

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-4.25	2.25	-6.50	-5.50	-5.75	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTB 2*10Y	11.50	2.50	9.00	9.70	10.20	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	15.41	-1.33	16.74	11.27	11.67	79.07	8.46	177.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	86.75/85.75		
01Y			
1.5Y			
02Y	75.75/76.5/76	SPRD	2y*5y -6.75/-6.5/-7
03Y			5y*7y -1/-0.75
04Y			5y*10y 2
05Y	69.5/69.25		
07Y			
10Y	70.5/71		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2y 09		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	130 건	10	120	96	155	87	95	47
금 액	42,518 억원	1,342	41,176	18,420	45,924	30,650	30,897	10,480

장중동향

국고채 금리, 3년물 금리 하락 & 10년물 금리 상승하며 혼조세 마감.
단기 구간은 기준금리 인하 기대 반영, 장기는 최근 강세 뒤 이익 실현 영향 반영.

IRS, 3Y이하 구간에서 금리 하락하며 혼조세. 커브 스티프닝.
글로벌 금리 오름세에도 이주열 한은 총재의 금리 인하 가능성에 오퍼리시한 모습을 보이며 단기금리 하락.

CRS, 일부 테너 금리 소폭 상승. 약보합 마감.