

IPS Daily Morning Brief

2019-02-27

종가 기준일 2019-02-26

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8800	-0.75	1.8850	1.8620	1.8721	1.9125	1.4675	2.1175	1.2875
9M	1.8725	-1.00	1.8800	1.8545	1.8623	1.9125	1.5325	2.1050	1.2500
1Y	1.8600	-1.00	1.8665	1.8394	1.8478	1.9200	1.6000	2.0925	1.2200
1.5Y	1.8350	-1.00	1.8395	1.8165	1.8299	2.0250	1.6875	2.1125	1.1900
2Y	1.8050	-1.00	1.8095	1.7866	1.8046	2.1150	1.7325	2.1350	1.1675
3Y	1.7725	-1.25	1.7765	1.7570	1.7784	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7625	-1.25	1.7660	1.7484	1.7733	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7575	-1.25	1.7605	1.7443	1.7723	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7575	-1.50	1.7625	1.7528	1.7824	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.7975	-1.25	1.8030	1.7974	1.8300	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8250	-1.25	1.8290	1.8239	1.8546	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8350	-1.25	1.8390	1.8356	1.8658	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8250	-1.25	1.8275	1.8218	1.8389	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-0.75	-0.25	-0.50	-0.75	-0.98	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.25	0.00	-1.35	-1.51	-1.45	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-5.50	0.00	-5.70	-5.28	-4.32	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.25	-0.25	-3.30	-2.96	-2.63	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.25	-0.25	-4.35	-3.83	-3.13	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-4.75	-0.25	-4.90	-4.24	-3.23	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-1.00	0.00	-1.05	-0.86	-0.50	8.50	-1.25	11.25	-1.25
3*5Y	-1.50	0.00	-1.60	-1.28	-0.60	14.00	-2.25	22.00	-2.25
4*5Y	-0.50	0.00	-0.55	-0.41	-0.10	6.00	-1.00	10.75	-1.00
5*7Y	0.00	-0.25	0.20	0.85	1.01	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	4.00	0.00	4.25	5.31	5.77	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.00	0.25	4.05	4.46	4.76	9.50	3.75	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.60	2.65	2.46	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	0.00	3.60	3.83	3.58	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	2.75	0.00	2.45	2.44	0.89	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.842	-0.90	1.842	1.827	1.823	1.935	1.570	2.130	1.237
1.5Y	1.850	-0.20	1.846	1.833	1.846	2.113	1.724	2.145	1.232
2Y	1.837	-0.80	1.838	1.825	1.838	2.230	1.797	2.230	1.225
3Y	1.808	-1.20	1.810	1.801	1.811	2.315	1.777	2.315	1.200
4Y	1.872	-1.50	1.878	1.869	1.882	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.878	-1.40	1.880	1.871	1.882	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.978	-1.70	1.984	1.975	1.975	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.995	-2.00	2.004	1.990	1.991	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.062	-1.30	2.070	2.049	2.014	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.89	0.00
CALL	1.75	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.22	0.05	109.20	109.23	109.18
LKTB	127.00	0.20	126.86	127.02	126.82

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	1.80	-0.10	2.45	1.27	2.49	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-1.50	-0.80	-0.67	-1.65	-1.64	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-3.20	-0.20	-2.87	-3.81	-3.30	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-3.55	-0.05	-3.35	-4.39	-3.22	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.95	0.25	-11.18	-12.03	-10.91	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.05	0.15	-11.95	-12.67	-10.92	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.05	0.20	-22.11	-22.22	-19.24	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.75	0.75	-20.08	-19.23	-16.14	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-23.70	0.05	-24.23	-22.73	-17.49	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1118.60 (-2.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-53.50	1.50	1Y	1.3250	0.50	1.6200	0.9950	1*2Y	-17.00	0.50		
-59.50	1.50	1.5Y	1.2400	0.50	1.6600	1.0250	2*3Y	-2.50	0.50		
-65.00	2.00	2Y	1.1550	1.00	1.6950	1.0450	2*5Y	-8.00	0.50		
-64.25	2.75	3Y	1.1300	1.50	1.7550	1.1100	3*4Y	-2.50	0.00		
-65.75	2.75	4Y	1.1050	1.50	1.8000	1.0850	3*5Y	-5.50	0.00		
-68.25	2.75	5Y	1.0750	1.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-3.00	0.00		
-60.25	3.00	7Y	1.1550	1.50	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.00		
-50.75	2.75	10Y	1.2900	1.50	2.0500	1.2600	5*10Y	21.50	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	2.4920	-0.0117	2.5037	2.4912	2.5286	2.9773	1.4832	2.9773	0.4100
10Y	2.6402	-0.0224	2.6626	2.6545	2.6977	3.2382	2.2778	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	65.50	-0.37	65.87	65.32	68.86	103.03	-53.43	103.03	-164.20
10Y	64.52	-0.24	64.76	65.25	68.27	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	-0.75	-0.25	-0.50	-1.00	0.00	42.50	-1.00	62.75	-1.00
KTb 2*10Y	15.80	-1.20	17.00	16.40	17.50	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	14.82	-1.07	15.89	16.33	16.91	85.87	8.46	184.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	88, 87.5, 87								
01Y									
1.5Y									
02Y	80.5	SPRD	2y*3y -3						
03Y									
04Y	76.25								
05Y	75.75								
07Y									
10Y	79.75, 80								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	18m 23 2y 15								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	101 건	43	58	34	97	135	110	63	
금 액	41,625 억원	26,866	14,759	17,735	26,350	47,406	39,386	17,309	

장중동향
 국고채 금리 하락.
 아시아증시와 미국 지수선물이 약세를 보인 영향.

IRS도 전테너 하락.
 현물과 마찬가지로 아시아 추가지수와 연동하며 레벨이 하락했고, 그동안 CD발행으로 급등했던 단기쪽으로 오퍼가 몰림.

CRS는 전테너 상승.