

IPS Daily Morning Brief

2019-03-04

종가 기준일 2019-02-28

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8825	0.25	1.8830	1.8646	1.8715	1.9125	1.4675	2.1175	1.2875
9M	1.8750	0.25	1.8765	1.8568	1.8613	1.9125	1.5325	2.1050	1.2500
1Y	1.8650	0.25	1.8650	1.8421	1.8464	1.9200	1.6000	2.0925	1.2200
1.5Y	1.8400	0.25	1.8395	1.8181	1.8274	2.0250	1.6875	2.1125	1.1900
2Y	1.8075	0.25	1.8085	1.7876	1.8010	2.1150	1.7325	2.1350	1.1675
3Y	1.7750	0.50	1.7755	1.7570	1.7734	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7625	0.50	1.7645	1.7475	1.7675	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7575	0.50	1.7595	1.7426	1.7659	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7600	0.75	1.7610	1.7501	1.7750	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.8000	0.75	1.8000	1.7938	1.8218	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8275	0.75	1.8270	1.8203	1.8463	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8375	0.75	1.8370	1.8318	1.8577	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8325	0.75	1.8285	1.8196	1.8309	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-0.75	0.00	-0.65	-0.79	-1.02	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.00	0.00	-1.15	-1.46	-1.50	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-5.75	0.00	-5.65	-5.45	-4.54	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.25	0.25	-3.30	-3.06	-2.75	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.50	0.25	-4.40	-4.01	-3.35	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-5.00	0.25	-4.90	-4.50	-3.51	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-1.25	0.00	-1.10	-0.95	-0.60	8.50	-1.25	11.25	-1.25
3*5Y	-1.75	0.00	-1.60	-1.44	-0.75	14.00	-2.25	22.00	-2.25
4*5Y	-0.50	0.00	-0.50	-0.49	-0.16	6.00	-1.00	10.75	-1.00
5*7Y	0.25	0.25	0.15	0.75	0.92	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	4.25	0.25	4.05	5.11	5.60	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.00	0.00	3.90	4.36	4.68	9.50	3.75	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.70	2.65	2.45	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	0.00	3.70	3.80	3.59	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	3.25	0.00	2.85	2.59	0.91	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.835	0.10	1.841	1.827	1.822	1.935	1.570	2.130	1.237
1.5Y	1.851	0.50	1.849	1.834	1.844	2.113	1.724	2.145	1.232
2Y	1.845	1.00	1.840	1.825	1.835	2.230	1.797	2.230	1.225
3Y	1.812	0.70	1.811	1.800	1.807	2.315	1.777	2.315	1.200
4Y	1.872	0.70	1.875	1.866	1.879	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.880	1.30	1.879	1.869	1.878	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.973	1.00	1.978	1.971	1.972	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.986	0.90	1.995	1.986	1.987	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.065	0.30	2.068	2.048	2.014	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.89	0.00
CALL	1.80	3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.22	-0.03	109.22	109.26	109.18
LKTB	127.10	-0.07	126.99	127.18	126.85

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	3.00	0.15	2.40	1.49	2.48	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-1.10	-0.25	-0.95	-1.57	-1.66	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-3.75	-0.75	-3.15	-3.77	-3.37	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-3.70	-0.20	-3.55	-4.28	-3.39	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.95	-0.20	-11.07	-11.88	-11.11	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.25	-0.80	-11.99	-12.59	-11.20	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.30	-0.25	-21.72	-22.07	-19.68	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-18.60	-0.15	-19.50	-19.19	-16.51	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-23.25	0.45	-23.95	-22.86	-18.31	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1124.70 (+5.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-52.50	1.75	1Y	1.3400	2.00	1.6200	0.9950	1*2Y	-16.00	0.50		
-58.00	2.25	1.5Y	1.2600	2.50	1.6600	1.0250	2*3Y	-2.50	0.00		
-62.75	2.25	2Y	1.1800	2.50	1.6950	1.0450	2*5Y	-6.50	1.00		
-62.00	2.00	3Y	1.1550	2.50	1.7550	1.1100	3*4Y	-1.50	0.50		
-62.25	2.50	4Y	1.1400	3.00	1.8000	1.0850	3*5Y	-4.00	1.00		
-64.25	3.00	5Y	1.1150	3.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-2.50	0.50		
-56.50	2.75	7Y	1.1950	3.50	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.00		
-47.00	2.75	10Y	1.3300	3.50	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	2.5202	0.0121	2.5081	2.4920	2.5037	2.9773	1.4970	2.9773	0.4100
10Y	2.7168	0.0334	2.6834	2.6402	2.6626	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	67.52	0.21	67.31	65.50	65.87	103.03	-53.43	103.03	-164.20
10Y	73.08	2.44	70.64	64.52	64.76	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	0.50	-1.25	-0.75	-0.50	42.50	-1.25	62.75	-1.25
KTb 2*10Y	14.10	-0.10	14.20	15.80	17.00	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	19.66	2.13	17.53	14.82	15.89	85.27	8.46	184.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6y 77.25						
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y		SPRD	9m*1y -1						
03Y			2y*5y -5						
04Y			5y*10y 4.25						
05Y									
07Y									
10Y	79.75								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y*2y -16								
	3y 15.5								
	2y 18								
	4y 12.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황		90 건	17	73	101	58	34	97	135
금 액		34,731 억원	5,836	28,895	41,625	14,759	17,735	26,350	47,406

장중동향

국고채 금리 상승.

장중 상승세 유지하던 금리는 장 후반 북미회담의 불확실성이 불거지며 상승폭을 일부 되돌리며 마감.

IRS도 채권 금리와 연동해 상승.

한국은행 총리의 매파적 발언에 비드가 우세했으나, 북미협상 결렬가능성에 상승폭 반납.

CRS도 전구간 상승 마감.