

IPS Daily Morning Brief

2019-03-05

종가 기준일 2019-03-04

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8900	0.75	1.8830	1.8680	1.8710	1.9125	1.4675	2.1175	1.2875
9M	1.8850	1.00	1.8760	1.8600	1.8605	1.9125	1.5350	2.1050	1.2500
1Y	1.8775	1.25	1.8660	1.8460	1.8450	1.9200	1.6000	2.0925	1.2200
1.5Y	1.8625	2.25	1.8430	1.8218	1.8252	2.0250	1.6900	2.1125	1.1900
2Y	1.8325	2.50	1.8115	1.7911	1.7979	2.1150	1.7325	2.1350	1.1675
3Y	1.8050	3.00	1.7795	1.7605	1.7695	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7950	3.25	1.7680	1.7504	1.7631	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7925	3.50	1.7635	1.7454	1.7615	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7975	3.75	1.7655	1.7523	1.7704	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.8375	3.75	1.8055	1.7951	1.8168	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8650	3.75	1.8330	1.8216	1.8414	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8750	3.75	1.8430	1.8329	1.8530	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8700	3.75	1.8370	1.8218	1.8263	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-0.50	0.25	-0.70	-0.80	-1.05	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-0.75	0.25	-1.00	-1.40	-1.55	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-4.50	1.25	-5.45	-5.49	-4.71	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.75	0.50	-3.20	-3.06	-2.84	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-3.75	0.75	-4.35	-4.08	-3.48	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-4.00	1.00	-4.80	-4.58	-3.63	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-1.00	0.25	-1.15	-1.01	-0.63	8.50	-1.25	11.25	-1.25
3*5Y	-1.25	0.50	-1.60	-1.51	-0.79	14.00	-2.25	22.00	-2.25
4*5Y	-0.25	0.25	-0.45	-0.50	-0.16	6.00	-1.00	10.75	-1.00
5*7Y	0.50	0.25	0.20	0.69	0.89	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	4.50	0.25	4.20	4.98	5.53	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.00	0.00	4.00	4.29	4.64	9.50	3.75	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.65	2.46	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	0.00	3.75	3.78	3.62	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	3.25	0.00	3.15	2.66	0.95	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.841	0.60	1.837	1.829	1.820	1.935	1.598	2.130	1.237
1.5Y	1.860	0.90	1.852	1.837	1.842	2.113	1.740	2.145	1.232
2Y	1.860	1.50	1.844	1.828	1.832	2.230	1.797	2.230	1.225
3Y	1.832	2.00	1.814	1.802	1.805	2.315	1.777	2.315	1.200
4Y	1.895	2.30	1.875	1.867	1.876	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.907	2.70	1.882	1.870	1.876	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	2.006	3.30	1.979	1.972	1.971	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	2.025	3.90	1.994	1.988	1.985	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.106	4.10	2.072	2.053	2.016	2.792	1.910	3.015	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.15	-0.07	109.14	109.16	109.12
LKTb	126.63	-0.47	126.70	126.73	126.60

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	3.65	0.65	2.86	1.71	2.48	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	0.25	1.35	-0.86	-1.50	-1.66	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-2.75	1.00	-3.29	-3.69	-3.44	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-2.70	1.00	-3.43	-4.13	-3.52	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.00	0.95	-10.72	-11.71	-11.30	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-11.45	0.80	-11.89	-12.48	-11.45	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-20.85	0.45	-21.31	-21.98	-20.07	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-18.75	-0.15	-18.83	-19.29	-16.82	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-23.60	-0.35	-23.50	-23.09	-18.96	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1124.90 (+0.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-52.25	0.25	1Y	1.3550	1.50	1.6200	0.9950	1*2Y	-15.50	0.50	
-58.75	-0.75	1.5Y	1.2750	1.50	1.6600	1.0750	2*3Y	-2.50	0.00	
-63.25	-0.50	2Y	1.2000	2.00	1.6950	1.1050	2*5Y	-6.00	0.50	
-63.00	-1.00	3Y	1.1750	2.00	1.7550	1.1100	3*4Y	-1.50	0.00	
-63.50	-1.25	4Y	1.1600	2.00	1.8000	1.0850	3*5Y	-3.50	0.50	
-65.25	-1.00	5Y	1.1400	2.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-2.00	0.50	
-57.75	-1.25	7Y	1.2200	2.50	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.00	
-48.25	-1.25	10Y	1.3550	2.50	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	2.5527	-0.0080	2.5607	2.5202	2.5081	2.9773	1.4970	2.9773	0.4100
10Y	2.7223	-0.0317	2.7540	2.7168	2.6834	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	69.27	-2.3	71.57	67.52	67.31	103.03	-53.43	103.03	-164.20
10Y	69.73	-7.07	76.80	73.08	70.64	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	0.50	1.25	-0.75	-0.75	-1.25	42.50	-1.25	62.75	-1.25
KTb 2*10Y	16.50	2.40	14.10	14.10	14.20	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	16.96	-2.37	19.33	19.66	17.53	84.50	8.46	184.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	89								
09M									
01Y	87.75								
1.5Y									
02Y					SPRD				
03Y									
04Y									
05Y									
07Y	79.5								
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y 17.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	90 건	0	90	90	73	101	58	34	
금 액	29,381 억원	-5,350	34,731	34,731	28,895	41,625	14,759	17,735	

장종동향
 국고채 금리 상승.
 미국 금리 상승과 외국인의 매도로 채권은 약세를 보였고 장종 변동성 없는 지루한 장세 유지.

IRS는 미국금리상승과 국고채금리의 상승분을 반영하며 상승.

CRS는 전 구간 상승 마감.