

IPS Daily Morning Brief

2019-03-13

종가 기준일 2019-03-12

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8900	0.00	1.8885	1.8796	1.8708	1.9125	1.5000	2.1175	1.2875
9M	1.8875	0.00	1.8860	1.8734	1.8613	1.9125	1.5825	2.1050	1.2500
1Y	1.8750	-0.25	1.8770	1.8614	1.8460	1.9200	1.6525	2.0925	1.2200
1.5Y	1.8525	-0.50	1.8585	1.8379	1.8254	2.0250	1.7400	2.1125	1.1900
2Y	1.8300	-0.25	1.8310	1.8084	1.7973	2.1150	1.7325	2.1350	1.1675
3Y	1.7950	0.00	1.7955	1.7764	1.7680	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7800	0.00	1.7815	1.7648	1.7608	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7700	0.00	1.7735	1.7590	1.7578	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7625	0.00	1.7680	1.7610	1.7653	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.7925	0.25	1.7980	1.7995	1.8097	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8200	0.25	1.8255	1.8260	1.8350	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8275	0.25	1.8330	1.8358	1.8470	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8175	0.00	1.8250	1.8265	1.8210	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-0.25	0.00	-0.25	-0.62	-0.96	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.25	-0.25	-0.90	-1.20	-1.53	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-4.50	0.00	-4.60	-5.30	-4.87	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.50	0.25	-3.55	-3.20	-2.92	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-5.00	0.25	-4.95	-4.36	-3.65	21.75	-5.25	23.50	-5.25
2*5Y	-6.00	0.25	-5.75	-4.94	-3.95	27.25	-6.25	34.00	-6.25
3*4Y	-1.50	0.00	-1.40	-1.16	-0.73	8.50	-1.50	11.25	-1.50
3*5Y	-2.50	0.00	-2.20	-1.74	-1.03	14.00	-2.50	22.00	-2.50
4*5Y	-1.00	0.00	-0.80	-0.58	-0.30	6.00	-1.00	10.75	-1.00
5*7Y	-0.75	0.00	-0.55	0.20	0.75	7.25	-0.75	14.75	-0.75
5*10Y	2.25	0.25	2.45	4.05	5.19	16.25	2.00	30.75	2.00
7*10Y	3.00	0.25	3.00	3.85	4.44	9.50	2.75	16.75	2.75
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.65	2.53	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.50	3.63	3.74	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	2.50	-0.25	2.70	2.70	1.14	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.825	-0.10	1.831	1.834	1.818	1.935	1.659	2.130	1.237
1.5Y	1.838	-0.40	1.847	1.845	1.839	2.113	1.767	2.145	1.232
2Y	1.837	-0.50	1.845	1.838	1.832	2.230	1.797	2.230	1.225
3Y	1.805	-0.80	1.814	1.809	1.806	2.315	1.777	2.315	1.200
4Y	1.870	-0.50	1.870	1.872	1.874	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.864	-0.30	1.876	1.876	1.875	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.962	-0.30	1.973	1.977	1.973	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.985	-0.20	1.995	1.996	1.986	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.050	1.50	2.049	2.059	2.025	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	109.25	0.02	109.22	109.25	109.21
LKTb	127.16	0.01	127.05	127.16	126.97

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 반영평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	5.00	-0.15	4.62	2.79	2.75	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	1.45	-0.10	1.13	-0.67	-1.37	1.55	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-0.70	0.25	-1.42	-3.00	-3.47	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-1.00	0.80	-1.85	-3.27	-3.76	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-9.00	0.50	-8.83	-10.71	-11.35	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.40	0.30	-10.27	-11.72	-11.74	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-19.95	0.30	-20.50	-21.56	-20.81	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.25	0.45	-19.74	-19.68	-17.59	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-23.25	-1.50	-22.44	-23.20	-20.44	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1129.80 (-3.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-51.50	-1.75	1Y	1.3600	-2.00	1.6200	0.9950	1*2Y	-15.00	2.00		
-57.25	-0.50	1.5Y	1.2800	-1.00	1.6600	1.1550	2*3Y	-2.00	0.50		
-62.00	0.25	2Y	1.2100	0.00	1.6950	1.1900	2*5Y	-6.00	0.00		
-60.50	0.50	3Y	1.1900	0.50	1.7550	1.1100	3*4Y	-1.00	0.00		
-60.00	0.50	4Y	1.1800	0.50	1.8000	1.0850	3*5Y	-4.00	-0.50		
-62.00	0.00	5Y	1.1500	0.00	1.8500	1.0400	4*5Y	-3.00	-0.50		
-56.25	0.00	7Y	1.2000	0.00	1.8950	1.0950	5*7Y	5.00	0.00		
-45.75	-0.25	10Y	1.3350	0.00	2.0500	1.2600	5*10Y	18.50	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	2.4547	-0.0246	2.4793	2.4671	2.4713	2.9773	1.5427	2.9773	0.4100
10Y	2.6087	-0.0333	2.6420	2.6330	2.6411	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	61.77	-1.96	63.73	62.71	62.13	103.03	-53.43	103.03	-163.00
10Y	62.37	-3.13	65.50	65.80	63.11	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	-3.75	0.50	-4.25	-4.25	-2.50	42.50	-4.25	62.75	-4.25
KTb 2*10Y	14.80	0.30	14.50	13.50	16.00	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	15.40	-0.87	16.27	16.59	16.98	84.50	8.46	184.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M									6Y 77
09M	88.75								
01Y									
1.5Y	85.75 / 85.5								
02Y	83.5								1*4Y -9.25
03Y	79.5								3*5Y -2.25
04Y									4*5Y -01
05Y									5*6Y -0.25 / -0.5
07Y									5*10Y 2.25
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y CCS 19 / 19.5 1.5*2y CCS -07								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			82 건	43	39	151	82	93	102
금 액			23,460 억원	12,870	10,590	53,023	21,466	29,753	34,470

장중동향
국고채 금리, 중장기물 중심으로 금리 상승.

IRS, 보험권에서 혼조세 마감.
장중 글로벌 금리 흐름에 영향으로 금리가 다소 올랐지만 후반에 외인의 국채선물 매수와 완화적 통화정책이 필요하다는 IMF 진단 영향으로 보험권 마무리.

CRS, 보험권 혼조세.
2y-3y 구간으로 활발했으며 비디쉬한 모습.