

IPS Daily Morning Brief

2019-03-20

종가 기준일 2019-03-19

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8950	-0.25	1.8920	1.8878	1.8706	1.9125	1.5300	2.1175	1.2875
9M	1.8900	-0.25	1.8870	1.8830	1.8619	1.9125	1.6275	2.1050	1.2500
1Y	1.8775	-0.25	1.8745	1.8720	1.8473	1.9200	1.7200	2.0925	1.2200
1.5Y	1.8550	-0.75	1.8520	1.8498	1.8265	2.0250	1.7700	2.1125	1.1900
2Y	1.8325	-1.00	1.8295	1.8219	1.7984	2.1150	1.7325	2.1350	1.1675
3Y	1.8000	-1.25	1.7980	1.7890	1.7696	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7850	-1.50	1.7835	1.7764	1.7614	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7750	-1.75	1.7745	1.7698	1.7578	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7675	-2.00	1.7665	1.7674	1.7638	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.7975	-2.00	1.7960	1.8021	1.8066	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8250	-2.00	1.8235	1.8293	1.8324	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8325	-2.00	1.8310	1.8379	1.8444	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8200	-2.00	1.8200	1.8290	1.8202	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-0.50	0.00	-0.50	-0.47	-0.87	11.75	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.25	0.00	-1.25	-1.10	-1.46	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-4.50	-0.75	-4.50	-5.01	-4.90	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.25	-0.25	-3.15	-3.29	-2.88	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.75	-0.50	-4.60	-4.55	-3.70	21.75	-5.25	23.50	-5.25
2*5Y	-5.75	-0.75	-5.50	-5.21	-4.05	27.25	-6.25	34.00	-6.25
3*4Y	-1.50	-0.25	-1.45	-1.26	-0.82	8.50	-1.75	11.25	-1.75
3*5Y	-2.50	-0.50	-2.35	-1.93	-1.18	14.00	-3.00	22.00	-3.00
4*5Y	-1.00	-0.25	-0.90	-0.66	-0.36	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	-0.75	-0.25	-0.80	-0.24	0.60	7.25	-1.00	14.75	-1.00
5*10Y	2.25	-0.25	2.15	3.24	4.88	16.25	1.75	30.75	1.75
7*10Y	3.00	0.00	2.95	3.48	4.28	9.50	2.75	16.75	2.75
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.71	2.58	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.50	3.58	3.78	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	2.25	0.00	2.40	2.69	1.36	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.831	0.00	1.830	1.835	1.820	1.935	1.757	2.130	1.237
1.5Y	1.840	0.00	1.838	1.846	1.837	2.113	1.809	2.145	1.232
2Y	1.845	-0.50	1.841	1.843	1.832	2.230	1.797	2.230	1.225
3Y	1.807	-0.30	1.800	1.811	1.807	2.315	1.777	2.315	1.200
4Y	1.875	-0.70	1.870	1.874	1.874	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.861	-1.10	1.860	1.876	1.875	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.952	-1.50	1.955	1.974	1.974	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.980	-1.70	1.984	1.996	1.987	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.030	-1.50	2.033	2.057	2.033	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.90	0.00
CALL	1.74	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.29	0.13	109.26	109.30	109.25
LKTb	127.27	0.33	127.08	127.32	127.06

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	4.65	-0.25	4.47	3.71	2.78	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	1.50	-0.75	1.36	0.33	-1.08	2.25	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-1.25	-0.50	-1.15	-2.16	-3.41	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-0.70	-0.95	-0.24	-2.19	-3.71	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-9.00	-0.80	-8.63	-9.79	-11.25	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-8.60	-0.65	-8.59	-10.66	-11.75	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-18.45	-0.50	-18.89	-20.67	-21.04	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-18.25	-0.30	-18.78	-19.37	-18.05	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-21.00	-0.50	-21.28	-22.82	-21.26	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1130.60 (-1.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-57.75	-2.25	1Y	1.3000	-2.50	1.6200	0.9950	1*2Y	-16.00	0.50	
-64.50	-1.25	1.5Y	1.2100	-2.00	1.6600	1.3000	2*3Y	-3.50	-0.50	
-69.25	-1.00	2Y	1.1400	-2.00	1.6950	1.3500	2*5Y	-8.00	-0.50	
-69.50	-1.25	3Y	1.1050	-2.50	1.7550	1.1050	3*4Y	-1.50	0.00	
-69.50	-1.00	4Y	1.0900	-2.50	1.8000	1.0850	3*5Y	-4.50	0.00	
-71.50	-0.75	5Y	1.0600	-2.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-3.00	0.00	
-66.75	-1.00	7Y	1.1000	-3.00	1.8950	1.0950	5*7Y	4.00	-0.50	
-56.25	-1.00	10Y	1.2350	-3.00	2.0500	1.2350	5*10Y	17.50	-0.50	

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	2.4706	0.0123	2.4583	2.4378	2.4668	2.9773	1.5757	2.9773	0.4100
10Y	2.6042	-0.0036	2.6078	2.5916	2.6294	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	62.56	1.73	60.83	59.28	63.18	103.03	-53.43	103.03	-160.00
10Y	62.42	1.34	61.08	59.96	64.94	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	-3.50	-1.00	-2.50	-2.75	-3.50	42.50	-4.50	62.75	-4.50
KTb 2*10Y	13.50	-1.20	14.70	14.70	14.50	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	13.36	-1.59	14.95	15.38	16.26	84.50	8.46	177.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y			9m*1y -1.25						
03Y		SPRD							
04Y									
05Y	78.5								
07Y									
10Y	81.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y 12 2y*3y -3.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	95 건	48	47	76	85	80	82	39	
금 액	30,897 억원	20,417	10,480	17,875	36,605	27,285	23,460	10,590	

장중동향
국고채 금리, 외국인 10년선물 매수영향으로 금리 상승.

IRS, 금리 하락. 커브 플랫트닝.
중시가 약세를 보인 데다 외국인이 국채선물을 사들여 금리가 하락세로 마무리.

CRS, 전 구간 금리 하락.