

IPS Daily Morning Brief

2019-03-21

종가 기준일 2019-03-20

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8950	0.00	1.8935	1.8881	1.8705	1.9125	1.5400	2.1175	1.2875
9M	1.8900	0.00	1.8885	1.8834	1.8620	1.9125	1.6375	2.1050	1.2500
1Y	1.8775	0.00	1.8760	1.8725	1.8473	1.9200	1.7400	2.0925	1.2200
1.5Y	1.8600	0.50	1.8545	1.8509	1.8263	2.0250	1.7700	2.1125	1.1900
2Y	1.8375	0.50	1.8325	1.8235	1.7983	2.1150	1.7325	2.1350	1.1675
3Y	1.8050	0.50	1.8010	1.7908	1.7695	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7875	0.25	1.7865	1.7779	1.7611	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7800	0.50	1.7785	1.7713	1.7575	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7725	0.50	1.7710	1.7684	1.7633	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.8000	0.25	1.8005	1.8024	1.8058	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8275	0.25	1.8280	1.8296	1.8316	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8350	0.25	1.8355	1.8381	1.8437	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8200	0.00	1.8235	1.8291	1.8199	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-0.50	0.00	-0.50	-0.47	-0.85	11.75	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.25	0.00	-1.25	-1.09	-1.47	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-4.00	0.50	-4.35	-4.90	-4.90	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.25	0.00	-3.15	-3.28	-2.88	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-5.00	-0.25	-4.60	-4.56	-3.72	21.75	-5.25	23.50	-5.25
2*5Y	-5.75	0.00	-5.40	-5.23	-4.08	27.25	-6.25	34.00	-6.25
3*4Y	-1.75	-0.25	-1.45	-1.29	-0.84	8.50	-1.75	11.25	-1.75
3*5Y	-2.50	0.00	-2.25	-1.95	-1.20	14.00	-3.00	22.00	-3.00
4*5Y	-0.75	0.25	-0.80	-0.66	-0.36	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	-0.75	0.00	-0.75	-0.29	0.58	7.25	-1.00	14.75	-1.00
5*10Y	2.00	-0.25	2.20	3.11	4.83	16.25	1.75	30.75	1.75
7*10Y	2.75	-0.25	2.95	3.40	4.25	9.50	2.75	16.75	2.75
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.73	2.59	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.50	3.58	3.79	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	2.00	-0.25	2.30	2.68	1.41	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.918	8.70	1.848	1.839	1.821	1.935	1.757	2.130	1.237
1.5Y	1.932	9.20	1.858	1.851	1.838	2.113	1.809	2.145	1.232
2Y	1.944	9.90	1.864	1.849	1.834	2.230	1.797	2.230	1.225
3Y	1.815	0.80	1.804	1.812	1.806	2.315	1.777	2.315	1.200
4Y	1.884	0.90	1.875	1.875	1.874	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.870	0.90	1.864	1.876	1.875	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.960	0.80	1.958	1.973	1.974	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.987	0.70	1.987	1.996	1.987	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.012	-1.80	2.030	2.055	2.034	2.792	1.910	3.015	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.25	-0.04	109.28	109.31	109.25
LKTb	127.16	-0.11	127.25	127.40	127.16

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	-4.05	-8.70	2.78	3.34	2.62	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-7.20	-8.70	-0.35	-0.03	-1.21	2.25	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-10.65	-9.40	-3.13	-2.56	-3.55	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-1.00	-0.30	-0.34	-2.08	-3.68	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-9.65	-0.65	-8.87	-9.71	-11.25	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.00	-0.40	-8.55	-10.51	-11.73	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-18.75	-0.30	-18.72	-20.50	-21.07	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-18.70	-0.45	-18.67	-19.32	-18.16	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-19.20	1.80	-20.63	-22.58	-21.37	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1130.40 (-0.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-60.75	-3.00	1Y	1.2700	-3.00	1.6200	0.9950	1*2Y	-16.50	-0.50	
-68.50	-4.00	1.5Y	1.1750	-3.50	1.6600	1.3000	2*3Y	-3.50	0.00	
-73.25	-4.00	2Y	1.1050	-3.50	1.6950	1.3500	2*5Y	-8.00	0.00	
-73.50	-4.00	3Y	1.0700	-3.50	1.7550	1.0700	3*4Y	-1.50	0.00	
-73.25	-3.75	4Y	1.0550	-3.50	1.8000	1.0550	3*5Y	-4.50	0.00	
-75.50	-4.00	5Y	1.0250	-3.50	1.8500	1.0250	4*5Y	-3.00	0.00	
-70.75	-4.00	7Y	1.0650	-3.50	1.8950	1.0650	5*7Y	4.00	0.00	
-60.00	-3.75	10Y	1.2000	-3.50	2.0500	1.2000	5*10Y	17.50	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	2.4003	-0.0703	2.4706	2.4583	2.4378	2.9773	1.5757	2.9773	0.4100
10Y	2.5334	-0.0708	2.6042	2.6078	2.5916	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	45.63	-16.93	62.56	60.83	59.28	103.03	-53.43	103.03	-160.00
10Y	54.64	-7.78	62.42	61.08	59.96	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	-0.25	-3.50	-2.50	-2.75	42.50	-4.50	62.75	-4.50
KTb 2*10Y	4.30	-9.20	13.50	14.70	14.70	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	13.31	-0.05	13.36	14.95	15.38	84.50	8.46	177.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6y 76.25						
06M									
09M	88.5/89								
01Y									
1.5Y									
02Y	83/82.75	SPRD	6m*9m -0.5						
03Y			9m*18m -3.5						
04Y	78.25		1y*4y -10						
05Y			5y*10y 2.25						
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y 27								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	87 건	-8	95	47	76	85	80	82	
금 액	30,650 억원	-247	30,897	10,480	17,875	36,605	27,285	23,460	

장중동향
 국고채 금리, FOMC 대기 모드에 금리 혼조세 마감.

IRS, 채권 금리에 연동되며 금리 상승.
 전반적으로 오퍼가 강해 본드스왑은 확대.

CRS, 애셋 물량에 금리 하락.