IPS Daily Morning Brief

2019-03-25

종가 기준일 2019-03-22

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8925	0.00	1.8945	1.8889	1.8707	1.9125	1.5525	2.1175	1.2875
9M	1.8850	0.00	1.8885	1.8838	1.8622	1.9125	1.6625	2.1050	1.2500
1Y	1.8725	0.00	1.8760	1.8730	1.8475	1.9200	1.7525	2.0925	1.2200
1.5Y	1.8425	0.00	1.8525	1.8511	1.8260	2.0250	1.7700	2.1125	1.1900
2Y	1.8100	0.00	1.8265	1.8234	1.7979	2.1150	1.7325	2.1350	1.1675
3Y	1.7700	-0.25	1.7920	1.7901	1.7688	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7475	-0.25	1.7740	1.7760	1.7598	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7375	0.00	1.7645	1.7688	1.7559	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7275	0.00	1.7565	1.7646	1.7612	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.7550	0.25	1.7845	1.7971	1.8030	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.7825	0.25	1.8120	1.8246	1.8291	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.7900	0.25	1.8195	1.8329	1.8411	2.5400	1.7875	2.7050	1.2150
20Y	1.7725	0.25	1.8045	1.8234	1.8181	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150
6*9M	-0.75	0.00	-0.60	-0.51	-0.85	11.75	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.25	0.00	-1.25	-1.08	-1.48	9.75	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-6.25	0.00	-4.95	-4.96	-4.95	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-4.00	-0.25	-3.45	-3.33	-2.92	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-6.25	-0.25	-5.25	-4.74	-3.81	21.75	-6.25	23.50	-6.25
2*5Y	-7.25	0.00	-6.20	-5.46	-4.20	27.25	-7.25	34.00	-7.25
3*4Y	-2.25	0.00	-1.80	-1.41	-0.89	8.50	-2.25	11.25	-2.25
3*5Y	-3.25	0.25	-2.75	-2.14	-1.28	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-1.00	0.25	-0.95	-0.73	-0.39	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	-1.00	0.00	-0.80	-0.41	0.53	7.25	-1.00	14.75	-1.00
5*10Y	1.75	0.25	2.00	2.84	4.71	16.25	1.50	30.75	1.50
7*10Y	2.75	0.25	2.80	3.25	4.18	9.50	2.50	16.75	2.50
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.75	2.61	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.50	3.58	3.81	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	1.75	0.00	2.00	2.63	1.51	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	1.848	1.838	1.821	1.935	1.757	2.130	1.237
1.5Y	1.840	0.30	1.858	1.850	1.838	2.113	1.809	2.145	1.232
2Y	1.835	0.50	1.861	1.848	1.833	2.230	1.797	2.230	1.225
3Y	1.797	0.50	1.804	1.810	1.805	2.315	1.777	2.315	1.200
4Y	1.852	0.20	1.869	1.872	1.872	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.822	-0.50	1.850	1.871	1.873	2.602	1.822	2.602	1.217
7Y	1.905	-0.10	1.938	1.965	1.972	2.728	1.905	2.728	1.270
10Y	1.932	0.00	1.966	1.988	1.986	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	1.932	-1.30	1.993	2.041	2.033	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.90	0.00
CALL	1.75	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.32	-0.02	109.34	109.34	109.31
LKTB	127.76	0.01	127.71	127.89	127.68

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	4.15	0.00	2.76	3.49	2.65	6.75	-11.00	9.00	-17.75
1.5Y	0.25	-0.30	-0.53	0.07	-1.15	2.25	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-2.50	-0.50	-3.43	-2.51	-3.50	-0.25	-17.00	-0.25	-25.15
3Y	-2.70	-0.75	-1.22	-1.99	-3.64	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.45	-0.45	-9.46	-9.61	-11.24	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-8.45	0.50	-8.59	-10.20	-11.69	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.75	0.10	-18.15	-20.07	-21.08	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-17.70	0.25	-18.11	-19.08	-18.33	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-15.95	1.55	-18.83	-21.76	-21.44	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-59.25	0.50
-66.25	0.00
-71.00	0.00
-71.00	0.75
-71.25	0.25
-73.75	0.00
-69.75	0.00
-58.00	0.75

CRS

USD/KRW 1130.10 (+2.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2800	0.50	1.6200	0.9950	1*2Y	-18.00	-0.50
1.5Y	1.1800	0.00	1.6600	1.2750	2*3Y	-4.00	0.50
2Y	1.1000	0.00	1.6950	1.3500	2*5Y	-10.00	0.00
3Y	1.0600	0.50	1.7550	1.0550	3*4Y	-2.50	-0.50
4Y	1.0350	0.00	1.8000	1.0350	3*5Y	-6.00	-0.50
5Y	1.0000	0.00	1.8500	1.0000	4*5Y	-3.50	0.00
7Y	1.0300	0.00	1.8950	1.0300	5*7Y	3.00	0.00
10Y	1.1750	1.00	2.0500	1.1650	5*10Y	17.50	1.00

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	2.3290	-0.0877	2.4167	2.4003	2.4706	2.9773	1.5757	2.9773	0.4100
10Y	2.4417	-0.0917	2.5334	2.5334	2.6042	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	49.40	-9.27	58.67	45.63	62.56	103.03	-53.43	103.03	-160.00
10Y	50.97	-9.17	60.14	54.64	62.42	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	-5.50	0.25	-5.75	-3.75	-3.50	42.50	-5.75	62.75	-5.75
KTB 2*10Y	9.70	-0.50	10.20	4.30	13.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	11.27	-0.40	11.67	13.31	13.36	79.49	8.46	177.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6y 72
06M			
09M			
01Y			
1.5Y	84.25		
02Y	81 / 81.25	SPRD	1y*2y -6
03Y	77		10y*20y 1.75/2/2.25
04Y			
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2y*3y -4.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	96 건	-59	155	87	95	47	76	85
금 액	18,420 억원	-27,504	45,924	30,650	30,897	10,480	17,875	36,605

장중동향

국고채 금리, 국채 3년과 10년물 금리 소폭 상승. 반면 초장기물 금리는 하락.

IRS, 대부분 구간에서 금리 보합 마감.
5Y 구간을 중심으로 오파가 좀 있었으나 적극적이지 않음. 리시브하기 어려운 장세.

CRS, 대부분 구간에서 금리 보합 마감.