IPS Daily Morning Brief

2019-03-15

종가 기준일 2019-03-14

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8850	-0.25	1.8875	1.8828	1.8705	1.9125	1.5225	2.1175	1.2875
9M	1.8800	-0.25	1.8840	1.8774	1.8613	1.9125	1.6225	2.1050	1.2500
1Y	1.8675	-0.25	1.8725	1.8659	1.8462	1.9200	1.7150	2.0925	1.2200
1.5Y	1.8425	-0.50	1.8505	1.8424	1.8254	2.0250	1.7700	2.1125	1.1900
2Y	1.8200	-0.25	1.8255	1.8135	1.7970	2.1150	1.7325	2.1350	1.1675
3Y	1.7875	-0.25	1.7905	1.7808	1.7678	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7725	0.00	1.7750	1.7688	1.7600	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7650	0.50	1.7650	1.7623	1.7566	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7550	0.50	1.7565	1.7620	1.7634	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.7850	0.75	1.7850	1.7989	1.8070	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8125	0.75	1.8125	1.8256	1.8326	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8200	0.75	1.8200	1.8349	1.8446	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8100	0.75	1.8110	1.8259	1.8192	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-0.50	0.00	-0.35	-0.54	-0.93	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.25	0.00	-1.15	-1.15	-1.50	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-4.75	0.00	-4.70	-5.24	-4.92	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.25	0.00	-3.50	-3.28	-2.93	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.75	0.25	-5.05	-4.48	-3.70	21.75	-5.25	23.50	-5.25
2*5Y	-5.50	0.75	-6.05	-5.13	-4.04	27.25	-6.25	34.00	-6.25
3*4Y	-1.50	0.25	-1.55	-1.20	-0.77	8.50	-1.75	11.25	-1.75
3*5Y	-2.25	0.75	-2.55	-1.85	-1.11	14.00	-3.00	22.00	-3.00
4*5Y	-0.75	0.50	-1.00	-0.65	-0.34	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	-1.00	0.00	-0.85	-0.03	0.68	7.25	-1.00	14.75	-1.00
5*10Y	2.00	0.25	2.00	3.66	5.04	16.25	1.75	30.75	1.75
7*10Y	3.00	0.25	2.85	3.69	4.37	9.50	2.75	16.75	2.75
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.68	2.55	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.50	3.60	3.76	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	2.50	0.00	2.60	2.70	1.21	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.829	0.30	1.826	1.834	1.818	1.935	1.757	2.130	1.237
1.5Y	1.838	0.40	1.839	1.845	1.838	2.113	1.809	2.145	1.232
2Y	1.835	0.50	1.837	1.840	1.832	2.230	1.797	2.230	1.225
3Y	1.790	-0.50	1.802	1.809	1.806	2.315	1.777	2.315	1.200
4Y	1.860	0.30	1.863	1.872	1.873	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.852	0.00	1.860	1.875	1.874	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.950	0.40	1.956	1.975	1.973	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.980	1.00	1.979	1.995	1.985	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.027	0.00	2.033	2.057	2.027	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.89	0.00
CALL	1.75	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.26	-0.02	109.27	109.29	109.24
LKTB	127.21	-0.11	127.24	127.35	127.13

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	3.85	-0.55	4.61	3.18	2.79	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	0.45	-0.90	1.19	-0.27	-1.26	1.55	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-1.50	-0.75	-1.13	-2.65	-3.45	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-0.25	0.25	-1.15	-2.83	-3.82	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-8.75	-0.30	-8.78	-10.28	-11.30	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-8.70	0.50	-9.54	-11.30	-11.74	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-19.50	0.10	-19.93	-21.29	-20.93	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.50	-0.25	-19.44	-19.64	-17.77	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-21.70	0.75	-22.18	-23.16	-20.82	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-52.25	0.25
-58.75	0.00
-63.50	-0.25
-62.75	-0.75
-62.75	-1.50
-65.00	-2.00
-59.50	-2.00
-49.00	-2.25

CRS

USD/KRW 1134.80 (+2.20)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3450	0.00	1.6200	0.9950	1*2Y	-16.00	-0.50
1.5Y	1.2550	-0.50	1.6600	1.2600	2*3Y	-2.50	-0.50
2Y	1.1850	-0.50	1.6950	1.2950	2*5Y	-7.00	-1.00
3Y	1.1600	-1.00	1.7550	1.1100	3*4Y	-1.50	-0.50
4Y	1.1450	-1.50	1.8000	1.0850	3*5Y	-4.50	-0.50
5Y	1.1150	-1.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-3.00	0.00
7Y	1.1600	-1.50	1.8950	1.0950	5*7Y	4.50	0.00
10Y	1.2950	-1.50	2.0500	1.2600	5*10Y	18.00	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	2.4668	0.0081	2.4587	2.4547	2.4793	2.9773	1.5681	2.9773	0.4100
10Y	2.6294	0.0081	2.6213	2.6087	2.6420	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	63.18	0.31	62.87	61.77	63.73	103.03	-53.43	103.03	-160.00
10Y	64.94	-0.19	65.13	62.37	65.50	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	-4.50	-3.75	-4.25	42.50	-4.50	62.75	-4.50
KTB 2*10Y	14.50	0.50	14.00	14.80	14.50	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	16.26	0.00	16.26	15.40	16.27	84.50	8.46	182.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	88		
01Y	86.75		
1.5Y			
02Y	82	SPRD	
03Y	78.75 / 79		
04Y			
05Y	76 / 76.5 / 76.25		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y CCS 34.5 3y CCS 16		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	85 건	5	80	82	39	151	82	93
금 액	36,605 억원	9,320	27,285	23,460	10,590	53,023	21,466	29,753

장중동향

국고채 금리, 보합권 혼조세 마감. 외국인 매도 확대

IRS, 3Y 이하 구간에서 금리 하락 & 5Y 이상 구간에서 금리 상승. 커브 스티프닝
9m 오퍼에 많은 수요가 몰리며 거래.

CRS, 대부분 구간에서 금리 하락.