# IPS Daily Morning Brief

**2019-03-19**

종가 기준일 2019-03-18

## IRS

| Tenor | Lv. | 전일비 | 5MA | 20MA | 60MA | 1Y Max | 1Y Min | 3Y Max | 3Y Min |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 6M | 1.8975 | 0.25 | 1.8910 | 1.8870 | 1.8706 | 1.9125 | 1.5225 | 2.1175 | 1.2875 |
| 9M | 1.8925 | 0.25 | 1.8865 | 1.8821 | 1.8618 | 1.9125 | 1.6225 | 2.1050 | 1.2500 |
| 1Y | 1.8800 | 0.25 | 1.8740 | 1.8710 | 1.8470 | 1.9200 | 1.7150 | 2.0925 | 1.2200 |
| 1.5Y | 1.8625 | 1.00 | 1.8515 | 1.8484 | 1.8263 | 2.0250 | 1.7700 | 2.1125 | 1.1900 |
| 2Y | 1.8425 | 1.25 | 1.8290 | 1.8201 | 1.7980 | 2.1150 | 1.7325 | 2.1350 | 1.1675 |
| 3Y | 1.8125 | 1.25 | 1.7970 | 1.7873 | 1.7691 | 2.2225 | 1.6975 | 2.2225 | 1.1550 |
| 4Y | 1.8000 | 1.25 | 1.7825 | 1.7749 | 1.7611 | 2.2950 | 1.6900 | 2.2950 | 1.1575 |
| 5Y | 1.7925 | 1.25 | 1.7735 | 1.7683 | 1.7575 | 2.3400 | 1.6825 | 2.3450 | 1.1575 |
| 7Y | 1.7875 | 1.50 | 1.7655 | 1.7665 | 1.7638 | 2.3950 | 1.7000 | 2.4525 | 1.1675 |
| 10Y | 1.8175 | 1.50 | 1.7950 | 1.8019 | 1.8068 | 2.4850 | 1.7525 | 2.5950 | 1.2125 |
| 12Y | 1.8450 | 1.50 | 1.8225 | 1.8289 | 1.8325 | 2.5225 | 1.7750 | 2.6450 | 1.2150 |
| 15Y | 1.8525 | 1.50 | 1.8300 | 1.8376 | 1.8445 | 2.5400 | 1.7950 | 2.7050 | 1.2150 |
| 20Y | 1.8400 | 1.25 | 1.8195 | 1.8288 | 1.8198 | 2.5600 | 1.7500 | 2.8725 | 1.2150 |

| | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 6*9M | -0.50 | 0.00 | -0.45 | -0.49 | -0.89 | 11.75 | -2.25 | 12.50 | -6.00 |
| 9*12M | -1.25 | 0.00 | -1.25 | -1.11 | -1.47 | 10.50 | -3.00 | 10.50 | -4.25 |
| 1*2Y | -3.75 | 1.00 | -4.50 | -5.09 | -4.90 | 23.00 | -6.75 | 23.00 | -6.75 |
| 2*3Y | -3.00 | 0.00 | -3.20 | -3.29 | -2.90 | 13.25 | -4.25 | 13.25 | -4.25 |
| 2*4Y | -4.25 | 0.00 | -4.65 | -4.53 | -3.70 | 21.75 | -5.25 | 23.50 | -5.25 |
| 2*5Y | -5.00 | 0.00 | -5.55 | -5.19 | -4.05 | 27.25 | -6.25 | 34.00 | -6.25 |
| 3*4Y | -1.25 | 0.00 | -1.45 | -1.24 | -0.80 | 8.50 | -1.75 | 11.25 | -1.75 |
| 3*5Y | -2.00 | 0.00 | -2.35 | -1.90 | -1.15 | 14.00 | -3.00 | 22.00 | -3.00 |
| 4*5Y | -0.75 | 0.00 | -0.90 | -0.66 | -0.35 | 6.00 | -1.25 | 10.75 | -1.25 |
| 5*7Y | -0.50 | 0.25 | -0.80 | -0.18 | 0.62 | 7.25 | -1.00 | 14.75 | -1.00 |
| 5*10Y | 2.50 | 0.25 | 2.15 | 3.36 | 4.93 | 16.25 | 1.75 | 30.75 | 1.75 |
| 7*10Y | 3.00 | 0.00 | 2.95 | 3.54 | 4.30 | 9.50 | 2.75 | 16.75 | 2.75 |
| 10*12Y | 2.75 | 0.00 | 2.75 | 2.70 | 2.57 | 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 | -0.25 | 2.45 | 2.69 | 1.30 | 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 | -0.10 | 1.829 | 1.835 | 1.819 | 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 | 1.850 | 0.50 | 1.839 | 1.843 | 1.832 | 2.230 | 1.797 | 2.230 | 1.225 |
| 3Y | 1.810 | 1.00 | 1.800 | 1.810 | 1.807 | 2.315 | 1.777 | 2.315 | 1.200 |
| 4Y | 1.882 | 0.70 | 1.869 | 1.874 | 1.874 | 2.502 | 1.837 | 2.502 | 1.232 |
| 5Y | 1.872 | 0.70 | 1.861 | 1.877 | 1.875 | 2.602 | 1.825 | 2.602 | 1.217 |
| 7Y | 1.967 | 0.50 | 1.957 | 1.975 | 1.974 | 2.728 | 1.913 | 2.728 | 1.270 |
| 10Y | 1.997 | 0.50 | 1.985 | 1.997 | 1.986 | 2.815 | 1.923 | 2.815 | 1.355 |
| 20Y | 2.045 | 1.00 | 2.037 | 2.058 | 2.031 | 2.792 | 1.910 | 3.015 | 1.430 |

| 기타금리 | Lv. | 전일비 |
|---|---|---|
| 91d CD | 1.90 | 0.00 |
| CALL | 1.76 | 3.00 |

| 국채선물 | Lv. | 전일비 | 시 | 고 | 저 |
|---|---|---|---|---|---|
| KTB | 109.16 | -0.03 | 109.20 | 109.21 | 109.15 |
| LKTB | 126.94 | -0.10 | 127.11 | 127.12 | 126.93 |

## 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 | 4.90 | 0.35 | 4.54 | 3.61 | 2.79 | 6.75 | -11.20 | 9.00 | -17.75 |
| 1.5Y | 2.25 | 1.00 | 1.35 | 0.22 | -1.12 | 2.25 | -15.60 | 2.40 | -19.10 |
| 2Y | -0.75 | 0.75 | -1.04 | -2.26 | -3.42 | -0.25 | -18.30 | -0.25 | -25.15 |
| 3Y | 0.25 | 0.25 | -0.30 | -2.32 | -3.75 | 2.55 | -13.50 | 4.75 | -19.50 |
| 4Y | -8.20 | 0.55 | -8.63 | -9.89 | -11.26 | -4.50 | -25.00 | 2.00 | -30.35 |
| 5Y | -7.95 | 0.55 | -8.75 | -10.83 | -11.75 | -3.20 | -27.25 | 4.55 | -27.25 |
| 7Y | -17.95 | 1.00 | -19.19 | -20.87 | -21.01 | -7.85 | -35.15 | -4.70 | -37.65 |
| 10Y | -17.95 | 1.00 | -18.98 | -19.48 | -17.95 | -7.50 | -37.50 | -7.50 | -38.70 |
| 20Y | -20.50 | 0.25 | -21.73 | -22.95 | -21.12 | 1.75 | -29.60 | 1.75 | -48.50 |

## BASIS SWAP

| Lv. | 전일비 |
|---|---|
| -55.50 | 0.25 |
| -63.25 | -0.50 |
| -68.25 | -0.75 |
| -68.25 | -0.75 |
| -68.50 | -0.75 |
| -70.75 | -0.75 |
| -65.75 | -1.00 |
| -55.25 | -1.00 |

## CRS

USD/KRW 1132.10 (-5.20)

| Tenor | Lv. | 전일비 | 1Y Max | 1Y Min | SPRD | Lv. | 전일비 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1Y | 1.3250 | 0.50 | 1.6200 | 0.9950 | 1*2Y | -16.50 | 0.00 |
| 1.5Y | 1.2300 | 0.50 | 1.6600 | 1.3000 | 2*3Y | -3.00 | 0.00 |
| 2Y | 1.1600 | 0.50 | 1.6950 | 1.3300 | 2*5Y | -7.50 | 0.00 |
| 3Y | 1.1300 | 0.50 | 1.7550 | 1.1100 | 3*4Y | -1.50 | 0.00 |
| 4Y | 1.1150 | 0.50 | 1.8000 | 1.0850 | 3*5Y | -4.50 | 0.00 |
| 5Y | 1.0850 | 0.50 | 1.8500 | 1.0400 | 4*5Y | -3.00 | 0.00 |
| 7Y | 1.1300 | 0.50 | 1.8950 | 1.0950 | 5*7Y | 4.50 | 0.00 |
| 10Y | 1.2650 | 0.50 | 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 | 2.4583 | 0.0205 | 2.4378 | 2.4668 | 2.4587 | 2.9773 | 1.5757 | 2.9773 | 0.4100 |
| 10Y | 2.6078 | 0.0162 | 2.5916 | 2.6294 | 2.6213 | 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 | 60.83 | 1.55 | 59.28 | 63.18 | 62.87 | 103.03 | -53.43 | 103.03 | -160.00 |
| 10Y | 61.08 | 1.12 | 59.96 | 64.94 | 65.13 | 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 | -2.50 | 0.25 | -2.75 | -3.50 | -4.50 | 42.50 | -4.50 | 62.75 | -4.50 |
| KTB 2*10Y | 14.70 | 0.00 | 14.70 | 14.50 | 14.00 | 63.50 | 8.50 | 82.90 | 8.50 |
| UST 2*10Y | 14.95 | -0.43 | 15.38 | 16.26 | 16.26 | 84.50 | 8.46 | 177.00 | 8.46 |

## TODAY MARKET DEAL LEVEL

| | | | |
|---|---|---|---|
| IRS | | ODD Tenor | 6y 77.5 |
| 06M | 89.75 | | 20y 82.75 |
| 09M | | | |
| 01Y | | | |
| 1.5Y | | | |
| 02Y | | SPRD | 6m*1y -1.75 |
| 03Y | | | 5y*6y -0.5 |
| 04Y | | | |
| 05Y | 78 | | |
| 07Y | 77.25/77.75 | | |
| 10Y | | | |
| 12Y | | | |
| 15Y | | | |
| 20Y | | | |
| CRS | 2y*3y -3 | | |

| TODAY KRX CCP | 전일비 | T-1 | T-2 | T-3 | T-4 | T-5 | T-6 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 거래현황 | 47 건 | -29 | 76 | 85 | 80 | 82 | 39 | 151 |
| 금 액 | 10,480 억원 | -7,395 | 17,875 | 36,605 | 27,285 | 23,460 | 10,590 | 53,023 |

## 장중동향

국고채 금리, 국고 10년물 입찰 부진 및 국채선물 롤오버 영향으로 금리 상승 마감.

IRS, 전 구간 금리 소폭 상승. 글로벌 금리 오름세 일부 영향.
장 후반 비디쉬한 모습을 보이며 테이큰 되는 장세.

CRS, 전 구간 금리 상승.