

IPS Daily Morning Brief

2019-02-07

종가 기준일 2019-02-06

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8525	0.00	1.8525	1.8541	1.8513	1.9125	1.4250	2.1350	1.2875
9M	1.8475	0.00	1.8475	1.8464	1.8511	1.9125	1.4675	2.1225	1.2500
1Y	1.8325	0.00	1.8325	1.8311	1.8445	1.9200	1.5100	2.1175	1.2200
1.5Y	1.8150	0.00	1.8150	1.8141	1.8376	2.0250	1.5625	2.1400	1.1900
2Y	1.7850	0.00	1.7850	1.7896	1.8236	2.1150	1.6025	2.1575	1.1675
3Y	1.7550	-0.25	1.7560	1.7653	1.8105	2.2225	1.6775	2.2225	1.1550
4Y	1.7500	-0.50	1.7520	1.7613	1.8145	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7475	-0.75	1.7505	1.7619	1.8199	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7575	-0.75	1.7605	1.7713	1.8355	2.3950	1.7000	2.4575	1.1675
10Y	1.8050	-0.75	1.8080	1.8183	1.8881	2.4850	1.7525	2.6000	1.2125
12Y	1.8325	-0.75	1.8355	1.8448	1.9136	2.5225	1.7750	2.6700	1.2150
15Y	1.8450	-0.75	1.8480	1.8586	1.9238	2.5400	1.7950	2.7400	1.2150
20Y	1.8300	-0.75	1.8330	1.8240	1.8987	2.5600	1.7500	2.8950	1.2150

6*9M	-0.50	0.00	-0.50	-0.78	-0.01	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.50	0.00	-1.50	-1.53	-0.66	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-4.75	0.00	-4.75	-4.15	-2.09	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.00	-0.25	-2.90	-2.44	-1.31	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-3.50	-0.50	-3.30	-2.84	-0.91	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-3.75	-0.75	-3.45	-2.78	-0.37	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.50	-0.25	-0.40	-0.40	0.40	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	-0.75	-0.50	-0.55	-0.34	0.94	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	-0.25	-0.25	-0.15	0.06	0.54	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	1.00	0.00	1.00	0.94	1.56	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.75	0.00	5.75	5.64	6.82	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.75	0.00	4.75	4.70	5.25	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.65	2.55	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.00	4.04	3.57	6.75	2.00	14.00	-0.75
10*20Y	2.50	0.00	2.50	0.57	1.06	10.25	-1.50	29.50	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.821	-0.50	1.823	1.814	1.836	1.935	1.492	2.130	1.237
1.5Y	1.826	-0.40	1.828	1.832	1.868	2.113	1.597	2.165	1.232
2Y	1.825	-0.20	1.826	1.828	1.864	2.230	1.680	2.230	1.225
3Y	1.802	-0.80	1.805	1.806	1.841	2.315	1.737	2.315	1.200
4Y	1.872	-0.80	1.875	1.876	1.919	2.502	1.849	2.502	1.232
5Y	1.877	-0.80	1.880	1.878	1.920	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.978	-1.10	1.982	1.985	2.010	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.982	-1.50	1.988	1.995	2.039	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.041	-0.40	2.043	2.039	2.036	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.74	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.29	0.02	109.29	109.30	109.23
LKTB	127.03	0.14	127.05	127.14	126.83

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.15	0.50	0.95	1.76	0.87	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-1.10	0.40	-1.26	-1.83	-3.06	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-4.00	0.20	-4.08	-3.81	-4.09	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-4.70	0.55	-4.92	-4.11	-3.05	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-12.20	0.30	-12.32	-11.49	-10.43	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.95	0.05	-12.97	-11.65	-10.04	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.05	0.35	-22.19	-21.36	-17.44	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-17.70	0.75	-18.00	-17.66	-15.05	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-21.10	-0.35	-20.96	-21.50	-13.71	1.75	-33.75	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1118.80 (+6.10)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-48.75	-3.50	1Y	1.3450	-3.50	1.6200	0.9650	1*2Y	-14.00	0.00
-54.50	-3.50	1.5Y	1.2700	-3.50	1.6600	0.9600	2*3Y	-2.50	0.50
-58.00	-3.50	2Y	1.2050	-3.50	1.6950	0.9750	2*5Y	-5.00	1.00
-57.50	-2.75	3Y	1.1800	-3.00	1.7550	1.0350	3*4Y	-1.50	0.50
-58.50	-2.00	4Y	1.1650	-2.50	1.8000	1.0850	3*5Y	-2.50	0.50
-59.25	-1.75	5Y	1.1550	-2.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-1.00	0.00
-52.25	-1.75	7Y	1.2350	-2.50	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.00
-43.50	-1.75	10Y	1.3700	-2.50	2.0500	1.2600	5*10Y	21.50	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	2.5283	0.0041	2.5242	2.5445	2.4999	2.9773	1.3635	2.9773	0.3500
10Y	2.6960	-0.0054	2.7014	2.7222	2.6855	3.2382	2.1867	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	70.33	0.61	69.72	71.95	67.49	103.03	-53.43	103.03	-182.70
10Y	71.40	0.96	70.44	74.02	70.35	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	2.00	-0.75	2.75	2.00	2.00	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	15.70	-1.30	17.00	15.70	15.70	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	16.77	-0.95	17.72	17.77	18.56	85.87	8.46	191.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y		SPRD	18m*2y -3						
03Y			1y*5y -8.5						
04Y									
05Y									
07Y									
10Y	80.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y*4y -0.19								
	5y 15								
	3y 17.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	83 건	-20	103	0	83	103	94	84	
금 액	25,647 억원	-8,676	34,323	0,000	25,647	34,323	25,058	29,609	

장종동향
국고채 금리, 인민은행 양적완화 부인 및 지표 악화로 금리 하락.

IRS, 3Y 이상 구간에서만 금리 소폭 하락.
중국 제조업PMI가 부진하게 나오자 안전자산 선호 분위기.

CRS, 전 구간 금리 하락.