IPS Daily Morning Brief

2019-02-08

종가 기준일 2019-02-07

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8525	0.00	1.8525	1.8539	1.8526	1.9125	1.4250	2.1300	1.2875
9M	1.8475	0.00	1.8475	1.8466	1.8518	1.9125	1.4675	2.1200	1.2500
1Y	1.8350	0.25	1.8330	1.8318	1.8447	1.9200	1.5100	2.1100	1.2200
1.5Y	1.8175	0.25	1.8155	1.8149	1.8371	2.0250	1.5625	2.1275	1.1900
2Y	1.7875	0.25	1.7855	1.7903	1.8222	2.1150	1.6050	2.1450	1.1675
3Y	1.7575	0.25	1.7555	1.7654	1.8080	2.2225	1.6775	2.2225	1.1550
4Y	1.7525	0.25	1.7505	1.7611	1.8114	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7500	0.25	1.7480	1.7615	1.8163	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7600	0.25	1.7580	1.7711	1.8316	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.8075	0.25	1.8055	1.8185	1.8839	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8350	0.25	1.8330	1.8451	1.9094	2.5225	1.7750	2.6500	1.2150
15Y	1.8475	0.25	1.8455	1.8588	1.9198	2.5400	1.7950	2.7200	1.2150
20Y	1.8325	0.25	1.8305	1.8256	1.8943	2.5600	1.7500	2.8750	1.2150

6*9M	-0.50	0.00	-0.50	-0.73	-0.08	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.25	0.25	-1.45	-1.49	-0.71	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-4.75	0.00	-4.75	-4.15	-2.25	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.00	0.00	-3.00	-2.49	-1.42	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-3.50	0.00	-3.50	-2.91	-1.08	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-3.75	0.00	-3.75	-2.88	-0.59	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.50	0.00	-0.50	-0.43	0.34	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	-0.75	0.00	-0.75	-0.39	0.83	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	-0.25	0.00	-0.25	0.04	0.50	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	1.00	0.00	1.00	0.96	1.53	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.75	0.00	5.75	5.70	6.76	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.75	0.00	4.75	4.74	5.23	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.66	2.55	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.00	4.03	3.58	6.75	2.00	14.00	-0.75
10*20Y	2.50	0.00	2.50	0.71	1.04	10.25	-1.50	29.50	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.824	0.30	1.822	1.816	1.835	1.935	1.496	2.130	1.237
1.5Y	1.828	0.20	1.826	1.833	1.867	2.113	1.597	2.150	1.232
2Y	1.820	-0.50	1.824	1.828	1.862	2.230	1.680	2.230	1.225
3Y	1.800	-0.20	1.802	1.806	1.838	2.315	1.737	2.315	1.200
4Y	1.871	-0.10	1.872	1.876	1.916	2.502	1.849	2.502	1.232
5Y	1.874	-0.30	1.876	1.879	1.917	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.978	0.00	1.978	1.985	2.007	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.992	1.00	1.984	1.996	2.035	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.057	1.60	2.044	2.043	2.034	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	109.28	-0.01	109.27	109.31	109.26
LKTB	126.94	-0.09	127.00	127.16	126.89

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	1.10	-0.05	1.14	1.62	0.98	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-1.05	0.05	-1.09	-1.80	-2.94	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-3.25	0.75	-3.85	-3.76	-4.01	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-4.25	0.45	-4.61	-4.10	-3.04	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.85	0.35	-12.13	-11.52	-10.47	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.40	0.55	-12.84	-11.75	-10.10	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.80	0.25	-22.00	-21.43	-17.54	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-18.45	-0.75	-17.85	-17.72	-15.08	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-22.45	-1.35	-21.37	-21.70	-13.99	1.75	-33.75	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-47.50	1.25
-52.75	1.75
-56.25	1.75
-55.75	1.75
-56.75	1.75
-57.50	1.75
-50.50	1.75
-41.75	1.75

CRS

USD/KRW 1124.10 (+5.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3600	1.50	1.6200	0.9650	1*2Y	-13.50	0.50
1.5Y	1.2900	2.00	1.6600	0.9600	2*3Y	-2.50	0.00
2Y	1.2250	2.00	1.6950	0.9750	2*5Y	-5.00	0.00
3Y	1.2000	2.00	1.7550	1.0350	3*4Y	-1.50	0.00
4Y	1.1850	2.00	1.8000	1.0850	3*5Y	-2.50	0.00
5Y	1.1750	2.00	1.8500	1.0400	4*5Y	-1.00	0.00
7Y	1.2550	2.00	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.00
10Y	1.3900	2.00	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	2.4835	-0.0448	2.5283	2.5242	2.5445	2.9773	1.3843	2.9773	0.3500
10Y	2.6562	-0.0398	2.6960	2.7014	2.7222	3.2382	2.2060	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	66.35	-3.98	70.33	69.92	71.95	103.03	-53.43	103.03	-182.70
10Y	66.42	-4.98	71.40	71.94	74.02	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	0.00	2.00	2.00	2.00	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTB 2*10Y	17.20	1.50	15.70	15.70	15.70	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	17.27	0.50	16.77	17.72	17.77	85.87	8.46	191.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	85.5	ODD Tenor	
09M	85		
01Y			
1.5Y	81.5		
02Y	78.5	SPRD	
03Y			
04Y			
05Y	74.5		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y 36		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	70 건	70	0	0	0	83	103	94
금 액	28,175 억원	28,175	0,000	0,000	0,000	25,647	34,323	25,058

장중동향

국고채 금리, 방향성 없이 금리 보합권 혼조세.

IRS, 대부분 구간에서 금리 소폭 상승.
거래도 그다지 활발하지 않은 편.

CRS도 금리 상승 마감.