

IPS Daily Morning Brief

2019-02-12

종가 기준일 2019-02-11

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8475	0.25	1.8500	1.8530	1.8551	1.9125	1.4350	2.1300	1.2875
9M	1.8325	-0.50	1.8425	1.8459	1.8528	1.9125	1.4825	2.1200	1.2500
1Y	1.8150	-0.75	1.8275	1.8311	1.8445	1.9200	1.5325	2.1050	1.2200
1.5Y	1.7900	-1.00	1.8075	1.8141	1.8354	2.0250	1.5875	2.1200	1.1900
2Y	1.7550	-1.25	1.7760	1.7886	1.8186	2.1150	1.6375	2.1350	1.1675
3Y	1.7225	-1.25	1.7450	1.7628	1.8023	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7100	-1.50	1.7375	1.7569	1.8043	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7000	-2.00	1.7330	1.7563	1.8083	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7150	-1.50	1.7440	1.7663	1.8230	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.7575	-1.50	1.7895	1.8131	1.8747	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.7850	-1.50	1.8170	1.8400	1.9000	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.7975	-1.50	1.8295	1.8533	1.9108	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.7850	-1.50	1.8155	1.8233	1.8849	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-1.50	-0.75	-0.75	-0.71	-0.23	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.75	-0.25	-1.50	-1.48	-0.82	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-6.00	-0.50	-5.15	-4.25	-2.60	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.25	0.00	-3.10	-2.59	-1.63	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.50	-0.25	-3.85	-3.18	-1.43	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-5.50	-0.75	-4.30	-3.24	-1.03	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-1.25	-0.25	-0.75	-0.59	0.21	8.50	-1.25	11.25	-1.25
3*5Y	-2.25	-0.75	-1.20	-0.65	0.60	14.00	-2.25	22.00	-2.25
4*5Y	-1.00	-0.50	-0.45	-0.06	0.40	6.00	-1.00	10.75	-1.00
5*7Y	1.50	0.50	1.10	1.00	1.48	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.75	0.50	5.65	5.69	6.64	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.25	0.00	4.55	4.69	5.16	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.69	2.54	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.00	4.01	3.61	6.75	2.00	13.75	-0.75
10*20Y	2.75	0.00	2.60	1.01	1.02	10.25	-1.50	29.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.809	0.00	1.817	1.817	1.833	1.935	1.503	2.130	1.237
1.5Y	1.817	0.00	1.823	1.832	1.863	2.113	1.620	2.150	1.232
2Y	1.797	-0.80	1.814	1.825	1.858	2.230	1.707	2.230	1.225
3Y	1.780	-0.20	1.793	1.805	1.834	2.315	1.770	2.315	1.200
4Y	1.837	-1.00	1.860	1.874	1.910	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.835	-1.70	1.863	1.877	1.911	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.932	-1.90	1.963	1.983	2.001	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.940	-2.20	1.972	1.992	2.026	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.007	-3.00	2.037	2.045	2.030	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.74	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.38	0.03	109.34	109.39	109.34
LKTb	127.54	0.29	127.25	127.54	127.23

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.60	-0.75	1.07	1.43	1.17	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-2.70	-1.00	-1.53	-1.80	-2.78	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-4.20	-0.45	-3.84	-3.67	-3.95	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-5.75	-1.05	-4.82	-4.18	-3.13	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-12.70	-0.50	-12.23	-11.67	-10.56	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-13.50	-0.30	-13.00	-12.06	-10.23	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.70	0.40	-21.94	-21.63	-17.76	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-18.25	0.70	-18.21	-17.93	-15.16	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-22.20	1.50	-22.11	-22.13	-14.53	1.75	-32.20	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1124.70 (+0.80)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-47.00	0.75	1Y	1.3450	0.00	1.6200	0.9900	1*2Y	-14.00	0.00		
-52.00	1.00	1.5Y	1.2700	0.00	1.6600	0.9900	2*3Y	-2.50	0.00		
-55.00	1.25	2Y	1.2050	0.00	1.6950	1.0000	2*5Y	-5.00	0.00		
-54.25	1.25	3Y	1.1800	0.00	1.7550	1.0550	3*4Y	-1.50	0.00		
-54.50	1.50	4Y	1.1650	0.00	1.8000	1.0850	3*5Y	-2.50	0.00		
-54.50	2.00	5Y	1.1550	0.00	1.8500	1.0400	4*5Y	-1.00	0.00		
-48.00	1.50	7Y	1.2350	0.00	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.00		
-38.75	1.50	10Y	1.3700	0.00	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	2.4997	0.0326	2.4671	2.4835	2.5283	2.9773	1.4052	2.9773	0.3600
10Y	2.6654	0.0315	2.6339	2.6562	2.6960	3.2382	2.2200	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	70.27	4.06	66.21	66.35	70.33	103.03	-53.43	103.03	-180.50
10Y	72.54	5.35	67.19	66.42	71.40	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	0.25	-0.25	0.50	2.00	2.00	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	14.30	-1.40	15.70	17.20	15.70	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	16.57	-0.11	16.68	17.27	16.77	85.87	8.46	191.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	76 / 75.75	SPRD	1y*5y -10.75						
03Y	72		2y*5y -5.5						
04Y			2y*10y 0 / 0.25						
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	60 건	-55	115	70	0	0	0	83	
금 액	18,215 억원	-17,516	35,731	28,175	0,000	0,000	0,000	25,647	

장중동향

국고채 금리, 초장기물의 금리 하락세가 시장 전반적 강세를 이끌며 금리 하락.

IRS, 한산한 가운데 금리 하락. 커브 플레이트닝.

5Y 구간에서 외은 중심으로 오퍼가 계속 나오면서 금리 하락. 헤지펀드 물량 추정.

CRS, 전 구간 보합 마감.