

IPS Daily Morning Brief

2019-02-14

종가 기준일 2019-02-13

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8575	0.50	1.8510	1.8534	1.8576	1.9125	1.4400	2.1300	1.2875
9M	1.8425	0.50	1.8395	1.8460	1.8536	1.9125	1.4925	2.1200	1.2500
1Y	1.8250	0.50	1.8235	1.8313	1.8440	1.9200	1.5425	2.1050	1.2200
1.5Y	1.8025	0.50	1.8015	1.8146	1.8333	2.0250	1.6050	2.1200	1.1900
2Y	1.7725	0.75	1.7695	1.7884	1.8148	2.1150	1.6525	2.1350	1.1675
3Y	1.7475	0.75	1.7405	1.7628	1.7967	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7350	0.75	1.7300	1.7564	1.7973	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7325	1.00	1.7250	1.7556	1.8003	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7450	0.75	1.7375	1.7663	1.8145	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.7900	0.75	1.7820	1.8134	1.8653	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8150	0.50	1.8090	1.8404	1.8906	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8275	0.50	1.8215	1.8534	1.9016	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8150	0.50	1.8085	1.8264	1.8754	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-1.50	0.00	-1.15	-0.74	-0.40	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.75	0.00	-1.60	-1.48	-0.96	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-5.25	0.25	-5.40	-4.29	-2.92	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.50	0.00	-2.90	-2.56	-1.81	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-3.75	0.00	-3.95	-3.20	-1.75	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-4.00	0.25	-4.45	-3.28	-1.45	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-1.25	0.00	-1.05	-0.64	0.06	8.50	-1.25	11.25	-1.25
3*5Y	-1.50	0.25	-1.55	-0.71	0.36	14.00	-2.25	22.00	-2.25
4*5Y	-0.25	0.25	-0.50	-0.07	0.30	6.00	-1.00	10.75	-1.00
5*7Y	1.25	-0.25	1.25	1.06	1.41	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.75	-0.25	5.70	5.78	6.50	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.50	0.00	4.45	4.71	5.09	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	-0.25	2.70	2.70	2.53	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	-0.25	3.95	4.00	3.63	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	2.50	-0.25	2.65	1.30	1.01	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.822	0.30	1.817	1.819	1.831	1.935	1.504	2.130	1.237
1.5Y	1.835	0.90	1.825	1.832	1.860	2.113	1.632	2.150	1.232
2Y	1.820	1.00	1.810	1.824	1.854	2.230	1.717	2.230	1.225
3Y	1.800	0.80	1.791	1.805	1.829	2.315	1.775	2.315	1.200
4Y	1.867	1.00	1.856	1.873	1.904	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.867	1.20	1.857	1.877	1.904	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.971	0.90	1.959	1.983	1.994	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.990	1.00	1.973	1.994	2.018	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.035	0.30	2.034	2.048	2.026	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	109.27	-0.04	109.31	109.32	109.25
LKTB	127.09	-0.11	127.15	127.26	127.00

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	0.30	0.20	0.69	1.27	1.33	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-3.25	-0.40	-2.31	-1.74	-2.66	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-4.75	-0.25	-4.09	-3.60	-3.89	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-5.25	-0.05	-5.03	-4.19	-3.19	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-13.20	-0.25	-12.58	-11.70	-10.63	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-13.45	-0.20	-13.16	-12.12	-10.35	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.60	-0.15	-22.13	-21.69	-18.00	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-20.00	-0.25	-19.08	-18.07	-15.30	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-22.00	0.20	-22.51	-22.17	-15.02	1.75	-31.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1121.70 (-2.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-48.50	-2.00	1Y	1.3400	-1.50	1.6200	0.9900	1*2Y	-16.50	-1.50		
-55.25	-3.00	1.5Y	1.2500	-2.50	1.6600	0.9900	2*3Y	-2.00	0.50		
-59.75	-3.75	2Y	1.1750	-3.00	1.6950	1.0000	2*5Y	-5.00	0.00		
-59.25	-3.25	3Y	1.1550	-2.50	1.7550	1.0550	3*4Y	-1.50	0.00		
-59.50	-3.25	4Y	1.1400	-2.50	1.8000	1.0850	3*5Y	-3.00	-0.50		
-60.75	-4.00	5Y	1.1250	-3.00	1.8500	1.0400	4*5Y	-1.50	-0.50		
-54.00	-3.75	7Y	1.2050	-3.00	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.00		
-45.00	-3.75	10Y	1.3400	-3.00	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	2.5367	0.0247	2.5120	2.4997	2.4671	2.9773	1.4271	2.9773	0.3800
10Y	2.7030	0.0171	2.6859	2.6654	2.6339	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	71.67	1.47	70.20	70.27	66.21	103.03	-53.43	103.03	-179.00
10Y	71.30	0.71	70.59	72.54	67.19	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	1.75	0.00	1.75	0.25	0.50	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	17.00	0.00	17.00	14.30	15.70	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	16.63	-0.76	17.39	16.57	16.68	85.87	8.46	191.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	82								
1.5Y									
02Y	77.25	SPRD							
03Y									
04Y									
05Y	73.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	5y 12								
	1y 33								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	82 건	30	52	60	115	70	0	0	
금 액	23,504 억원	-751	24,255	18,215	35,731	28,175	0,000	0,000	

장중동향

국고채 금리 소폭 상승.

미중 무역협상 기대와 국내 고용불안이 함께 작용. 초장기물은 50년을 입찰을 앞두고 금리 소폭 하락 마감.

IRS는 채권 금리상승을 반영해 레벨 상승.

변동이 크지 않은가운데 채권과 연동해 움직임.

CRS는 하락 마감.