

IPS Daily Morning Brief

2019-02-15

종가 기준일 2019-02-14

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8525	-0.50	1.8510	1.8533	1.8589	1.9125	1.4400	2.1250	1.2875
9M	1.8400	-0.25	1.8380	1.8458	1.8541	1.9125	1.4925	2.1175	1.2500
1Y	1.8225	-0.25	1.8210	1.8311	1.8438	1.9200	1.5425	2.1025	1.2200
1.5Y	1.7975	-0.50	1.7975	1.8144	1.8324	2.0250	1.6050	2.1150	1.1900
2Y	1.7675	-0.50	1.7655	1.7876	1.8132	2.1150	1.6525	2.1350	1.1675
3Y	1.7425	-0.50	1.7375	1.7620	1.7943	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7300	-0.50	1.7255	1.7554	1.7943	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7275	-0.50	1.7205	1.7545	1.7968	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7400	-0.50	1.7335	1.7654	1.8106	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.7850	-0.50	1.7775	1.8125	1.8612	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8100	-0.50	1.8040	1.8395	1.8863	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8225	-0.50	1.8165	1.8524	1.8975	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8100	-0.50	1.8040	1.8270	1.8712	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-1.25	0.25	-1.30	-0.75	-0.48	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.75	0.00	-1.70	-1.46	-1.03	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-5.50	-0.25	-5.55	-4.35	-3.06	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.50	0.00	-2.80	-2.56	-1.89	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-3.75	0.00	-4.00	-3.23	-1.90	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-4.00	0.00	-4.50	-3.31	-1.64	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-1.25	0.00	-1.20	-0.66	-0.01	8.50	-1.25	11.25	-1.25
3*5Y	-1.50	0.00	-1.70	-0.75	0.25	14.00	-2.25	22.00	-2.25
4*5Y	-0.25	0.00	-0.50	-0.09	0.26	6.00	-1.00	10.75	-1.00
5*7Y	1.25	0.00	1.30	1.09	1.38	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.75	0.00	5.70	5.80	6.43	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.50	0.00	4.40	4.71	5.05	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.00	2.65	2.70	2.52	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	0.00	3.90	3.99	3.64	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	2.50	0.00	2.65	1.45	1.00	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.821	-0.10	1.816	1.819	1.830	1.935	1.505	2.130	1.237
1.5Y	1.827	-0.80	1.824	1.832	1.858	2.113	1.632	2.145	1.232
2Y	1.812	-0.80	1.809	1.824	1.852	2.230	1.717	2.230	1.225
3Y	1.787	-1.30	1.788	1.804	1.826	2.315	1.775	2.315	1.200
4Y	1.856	-1.10	1.853	1.872	1.901	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.855	-1.20	1.853	1.876	1.901	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.960	-1.10	1.955	1.983	1.992	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.980	-1.00	1.970	1.994	2.015	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.040	0.50	2.030	2.049	2.023	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.75	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.29	0.02	109.28	109.30	109.25
LKTb	127.18	0.09	127.15	127.20	127.02

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	0.15	-0.15	0.50	1.17	1.42	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-2.95	0.30	-2.69	-1.74	-2.58	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-4.45	0.30	-4.33	-3.61	-3.83	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-4.45	0.80	-5.07	-4.20	-3.17	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-12.60	0.60	-12.73	-11.71	-10.64	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.75	0.70	-13.23	-12.13	-10.38	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.00	0.60	-22.17	-21.71	-18.10	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.50	0.50	-19.29	-18.18	-15.35	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-23.00	-1.00	-22.62	-22.23	-15.22	1.75	-29.70	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1125.10 (+3.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-48.25	0.25	1Y	1.3400	0.00	1.6200	0.9900	1*2Y	-17.00	-0.50		
-55.25	0.00	1.5Y	1.2450	-0.50	1.6600	0.9900	2*3Y	-2.00	0.00		
-59.75	0.00	2Y	1.1700	-0.50	1.6950	1.0000	2*5Y	-5.50	-0.50		
-59.25	0.00	3Y	1.1500	-0.50	1.7550	1.0550	3*4Y	-1.50	0.00		
-59.50	0.00	4Y	1.1350	-0.50	1.8000	1.0850	3*5Y	-3.50	-0.50		
-61.25	-0.50	5Y	1.1150	-1.00	1.8500	1.0400	4*5Y	-2.00	-0.50		
-54.50	-0.50	7Y	1.1950	-1.00	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.00		
-45.50	-0.50	10Y	1.3300	-1.00	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	2.5038	-0.0329	2.5367	2.5120	2.4997	2.9773	1.4271	2.9773	0.3800
10Y	2.6554	-0.0476	2.7030	2.6859	2.6654	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	69.18	-2.49	71.67	70.20	70.27	103.03	-53.43	103.03	-179.00
10Y	67.54	-3.76	71.30	70.59	72.54	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	1.75	0.25	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	16.80	-0.20	17.00	17.00	14.30	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	15.16	-1.47	16.63	17.39	16.57	85.87	8.46	191.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y	82.25/82.5								
1.5Y									
02Y					SPRD	2y*5y -4			
03Y									
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y*2y -17								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	46 건		-36	82	52	60	115	70	0
금 액	12,890 억원		-10,614	23,504	24,255	18,215	35,731	28,175	0,000

장중동향
국고채 혼조 마감.
미국금리 하락으로 초반에 강세 출발한 국채선물은 미중 무역협상 연기 가능성 소식에 약세전환. 등락을 거듭하다 강보합 마감.

IRS는 하락 마감.
최근 계속 이어지는 조용한 분위기에 거의 거래가 없이 한산.

CRS는 1년을 제외한 전 구간 하락 마감.