IPS Daily Morning Brief

2019-02-19

종가 기준일 2019-02-18

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8575	0.75	1.8540	1.8529	1.8614	1.9125	1.4550	2.1175	1.2875
9M	1.8500	1.25	1.8415	1.8450	1.8551	1.9125	1.5125	2.1050	1.2500
1Y	1.8350	1.50	1.8245	1.8298	1.8436	1.9200	1.5700	2.0925	1.2200
1.5Y	1.8075	2.00	1.7985	1.8113	1.8304	2.0250	1.6450	2.1125	1.1900
2Y	1.7800	2.00	1.7690	1.7833	1.8098	2.1150	1.6975	2.1350	1.1675
3Y	1.7525	2.25	1.7425	1.7565	1.7891	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7450	2.50	1.7315	1.7498	1.7878	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7400	2.75	1.7270	1.7480	1.7894	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7500	3.00	1.7385	1.7586	1.8024	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.7950	3.00	1.7835	1.8054	1.8523	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8200	3.00	1.8090	1.8324	1.8773	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8325	3.00	1.8215	1.8450	1.8887	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8200	3.00	1.8090	1.8229	1.8621	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-0.75	0.50	-1.25	-0.79	-0.63	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.50	0.25	-1.70	-1.53	-1.15	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-5.50	0.50	-5.55	-4.65	-3.38	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.75	0.25	-2.65	-2.68	-2.07	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-3.50	0.50	-3.75	-3.35	-2.20	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-4.00	0.75	-4.20	-3.53	-2.04	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.75	0.25	-1.10	-0.67	-0.13	8.50	-1.25	11.25	-1.25
3*5Y	-1.25	0.50	-1.55	-0.85	0.03	14.00	-2.25	22.00	-2.25
4*5Y	-0.50	0.25	-0.45	-0.18	0.16	6.00	-1.00	10.75	-1.00
5*7Y	1.00	0.25	1.15	1.06	1.30	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.50	0.25	5.65	5.74	6.28	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.50	0.00	4.50	4.68	4.98	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.00	2.55	2.70	2.50	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	0.00	3.80	3.96	3.65	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	2.50	0.00	2.55	1.75	0.99	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.826	0.60	1.822	1.820	1.827	1.935	1.524	2.130	1.237
1.5Y	1.834	1.00	1.829	1.831	1.855	2.113	1.669	2.145	1.232
2Y	1.830	1.90	1.817	1.822	1.847	2.230	1.765	2.230	1.225
3Y	1.802	2.20	1.792	1.801	1.821	2.315	1.777	2.315	1.200
4Y	1.867	2.20	1.858	1.869	1.895	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.870	2.80	1.858	1.872	1.894	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.976	3.00	1.963	1.978	1.986	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.997	3.20	1.982	1.990	2.007	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.047	3.00	2.034	2.047	2.019	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.87	1.00
CALL	1.78	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.25	-0.08	109.31	109.32	109.25
LKTB	127.01	-0.37	127.25	127.29	127.04

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	0.90	0.90	0.29	0.94	1.64	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-2.65	1.00	-3.07	-1.98	-2.42	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-5.00	0.10	-4.76	-3.92	-3.74	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-4.95	0.05	-4.97	-4.49	-3.19	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-12.20	0.30	-12.69	-11.92	-10.69	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-13.00	-0.05	-13.08	-12.38	-10.48	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.60	0.00	-22.45	-21.94	-18.33	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-20.20	-0.20	-19.89	-18.49	-15.49	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-22.70	0.00	-22.52	-22.39	-15.69	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-49.50	-2.00
-55.75	-2.00
-61.50	-1.50
-60.75	-1.25
-62.00	-1.50
-63.50	-1.75
-56.50	-2.00
-47.50	-2.00

CRS

USD/KRW 1125.80 (-2.90)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3400	-0.50	1.6200	0.9900	1*2Y	-17.50	1.00
1.5Y	1.2500	0.00	1.6600	0.9900	2*3Y	-2.00	0.50
2Y	1.1650	0.50	1.6950	1.0000	2*5Y	-6.00	0.50
3Y	1.1450	1.00	1.7550	1.0550	3*4Y	-2.00	0.00
4Y	1.1250	1.00	1.8000	1.0850	3*5Y	-4.00	0.00
5Y	1.1050	1.00	1.8500	1.0400	4*5Y	-2.00	0.00
7Y	1.1850	1.00	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.00
10Y	1.3200	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	2.5203	0.0000	2.5203	2.5038	2.5367	2.9773	1.4315	2.9773	0.4100
10Y	2.6662	0.0000	2.6662	2.6554	2.7030	3.2382	2.2377	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	69.03	-1.9	70.93	69.18	71.67	103.03	-53.43	103.03	-167.50
10Y	66.92	-3.20	70.12	67.54	71.30	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	1.50	1.00	0.50	1.75	1.75	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTB 2*10Y	16.70	1.30	15.40	16.80	17.00	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	14.59	0.00	14.59	15.16	16.63	85.87	8.46	185.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	83.5		
1.5Y			
02Y	78	SPRD	9*1y -1.5
03Y			
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	78.75/79		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	63 건	10	53	46	82	52	60	115
금 액	17,309 억원	5,404	11,905	12,890	23,504	24,255	18,215	35,731

장중동향

국고채 금리상승.
FOMC의사록외에는 특별한 재료가 없는가운데 계속되는 부진한 장세. 미국 무역 협상의 낙관적 분위기와 증시 상승으로 채권 금리 상승.

IRS는 채권의 약세 영향으로 전구간 상승. 커브 스티프닝.
장 초반부터 비디시하게 오파를 찾음. 거의 거래가 없는 조용한 분위기 속에 장 후반으로 거래 쏠림.

CRS도 대부분 구간에서 상승.