

IPS Daily Morning Brief

2019-02-20

종가 기준일 2019-02-19

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8800	2.25	1.8595	1.8545	1.8632	1.9125	1.4675	2.1175	1.2875
9M	1.8725	2.25	1.8485	1.8466	1.8562	1.9125	1.5325	2.1050	1.2500
1Y	1.8575	2.25	1.8320	1.8311	1.8441	1.9200	1.6000	2.0925	1.2200
1.5Y	1.8275	2.00	1.8045	1.8118	1.8301	2.0250	1.6875	2.1125	1.1900
2Y	1.7975	1.75	1.7755	1.7835	1.8087	2.1150	1.7325	2.1350	1.1675
3Y	1.7650	1.25	1.7475	1.7564	1.7870	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7550	1.00	1.7370	1.7493	1.7850	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7450	0.50	1.7315	1.7469	1.7860	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7500	0.00	1.7410	1.7573	1.7986	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.7925	-0.25	1.7855	1.8038	1.8480	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8175	-0.25	1.8105	1.8306	1.8730	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8275	-0.50	1.8225	1.8430	1.8844	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8150	-0.50	1.8100	1.8224	1.8577	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-0.75	0.00	-1.10	-0.79	-0.70	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.50	0.00	-1.65	-1.55	-1.21	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-6.00	-0.50	-5.65	-4.76	-3.54	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.25	-0.50	-2.80	-2.71	-2.18	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.25	-0.75	-3.85	-3.43	-2.38	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-5.25	-1.25	-4.40	-3.66	-2.27	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-1.00	-0.25	-1.05	-0.71	-0.20	8.50	-1.25	11.25	-1.25
3*5Y	-2.00	-0.75	-1.60	-0.95	-0.09	14.00	-2.25	22.00	-2.25
4*5Y	-1.00	-0.50	-0.55	-0.24	0.11	6.00	-1.00	10.75	-1.00
5*7Y	0.50	-0.50	0.95	1.04	1.25	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	4.75	-0.75	5.40	5.69	6.20	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.25	-0.25	4.45	4.65	4.95	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.00	2.50	2.69	2.49	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	-0.25	3.70	3.93	3.64	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	2.25	-0.25	2.45	1.86	0.97	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.831	0.50	1.824	1.821	1.826	1.935	1.566	2.130	1.237
1.5Y	1.836	0.20	1.831	1.831	1.853	2.113	1.712	2.145	1.232
2Y	1.830	0.00	1.821	1.823	1.845	2.230	1.797	2.230	1.225
3Y	1.797	-0.50	1.793	1.801	1.819	2.315	1.777	2.315	1.200
4Y	1.865	-0.20	1.860	1.869	1.892	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.865	-0.50	1.860	1.872	1.891	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.975	-0.10	1.966	1.978	1.983	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.997	0.00	1.986	1.990	2.004	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.052	0.50	2.038	2.047	2.017	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.88	1.00
CALL	1.75	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.25	0.00	109.26	109.27	109.23
LKTb	127.00	-0.01	127.05	127.09	126.93

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	2.65	1.75	0.80	0.98	1.80	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-0.85	1.80	-2.67	-1.96	-2.29	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-3.25	1.75	-4.51	-3.96	-3.66	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-3.20	1.75	-4.57	-4.50	-3.17	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.00	1.20	-12.30	-11.97	-10.71	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.00	1.00	-12.83	-12.47	-10.53	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.50	0.10	-22.46	-22.05	-18.45	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-20.45	-0.25	-20.03	-18.66	-15.56	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-23.70	-1.00	-22.82	-22.45	-15.94	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1128.20 (+2.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-51.75	-2.25	1Y	1.3400	0.00	1.6200	0.9950	1*2Y	-17.50	0.00		
-57.75	-2.00	1.5Y	1.2500	0.00	1.6600	0.9900	2*3Y	-2.00	0.00		
-63.25	-1.75	2Y	1.1650	0.00	1.6950	1.0000	2*5Y	-6.50	-0.50		
-62.00	-1.25	3Y	1.1450	0.00	1.7550	1.0550	3*4Y	-2.50	-0.50		
-63.50	-1.50	4Y	1.1200	-0.50	1.8000	1.0850	3*5Y	-4.50	-0.50		
-64.50	-1.00	5Y	1.1000	-0.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-2.00	0.00		
-56.50	0.00	7Y	1.1850	0.00	1.8950	1.0950	5*7Y	8.50	0.50		
-47.25	0.25	10Y	1.3200	0.00	2.0500	1.2600	5*10Y	22.00	0.50		

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	2.4955	-0.0248	2.5203	2.5203	2.5038	2.9773	1.4505	2.9773	0.4100
10Y	2.6384	-0.0278	2.6662	2.6662	2.6554	3.2382	2.2778	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	66.55	-2.48	69.03	70.93	69.18	103.03	-53.43	103.03	-165.00
10Y	64.14	-2.78	66.92	70.12	67.54	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	-0.50	-2.00	1.50	0.50	1.75	42.50	-0.50	62.75	-0.50
KTb 2*10Y	16.70	0.00	16.70	15.40	16.80	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	14.29	-0.30	14.59	14.59	15.16	85.87	8.46	185.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M									
09M	87								
01Y									
1.5Y									
02Y	79.5							2y*3y -2.75 / -3.25	
03Y								5y*6y 0.25	
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y CCS 16.5								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	110 건		47	63	53	46	82	52	60
금 액	39,386 억원		22,077	17,309	11,905	12,890	23,504	24,255	18,215

장중동향

국고채 금리, 변동성이 줄어든 가운데 금리 소폭 하락 마감.

IRS, CD발행 등을 반영하며 단기구간을 중심으로 금리 상승. 장기구간은 보합권.
오후CD 91d 1.88%(전일대비 +01bp)

CRS, 4-5Y 구간은 금리 하락했으나 대부분 구간 보합 마감.