

IPS Daily Morning Brief

2019-02-22

종가 기준일 2019-02-21

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8850	-0.25	1.8720	1.8576	1.8668	1.9125	1.4675	2.1175	1.2875
9M	1.8825	0.00	1.8650	1.8501	1.8588	1.9125	1.5325	2.1050	1.2500
1Y	1.8675	0.00	1.8495	1.8346	1.8457	1.9200	1.6000	2.0925	1.2200
1.5Y	1.8400	0.25	1.8200	1.8136	1.8301	2.0250	1.6875	2.1125	1.1900
2Y	1.8125	0.75	1.7910	1.7849	1.8072	2.1150	1.7325	2.1350	1.1675
3Y	1.7800	1.00	1.7595	1.7568	1.7836	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7700	1.25	1.7495	1.7489	1.7803	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7650	1.50	1.7425	1.7459	1.7805	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7675	1.50	1.7480	1.7556	1.7920	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.8125	1.75	1.7920	1.8018	1.8410	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8375	1.75	1.8170	1.8284	1.8658	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8475	1.75	1.8280	1.8405	1.8773	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8350	1.75	1.8155	1.8226	1.8504	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-0.25	0.25	-0.70	-0.75	-0.80	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.50	0.00	-1.55	-1.55	-1.31	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-5.50	0.75	-5.85	-4.98	-3.85	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.25	0.25	-3.15	-2.81	-2.36	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.25	0.50	-4.15	-3.60	-2.69	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-4.75	0.50	-4.85	-3.90	-2.67	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-1.00	0.25	-1.00	-0.79	-0.33	8.50	-1.25	11.25	-1.25
3*5Y	-1.50	0.50	-1.70	-1.09	-0.31	14.00	-2.25	22.00	-2.25
4*5Y	-0.50	0.25	-0.70	-0.30	0.02	6.00	-1.00	10.75	-1.00
5*7Y	0.25	0.00	0.55	0.98	1.15	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	4.75	0.25	4.95	5.59	6.05	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.50	0.25	4.40	4.61	4.90	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.00	2.50	2.66	2.48	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.60	3.88	3.62	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	2.25	0.00	2.35	2.09	0.93	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.840	0.60	1.830	1.824	1.824	1.935	1.570	2.130	1.237
1.5Y	1.846	0.90	1.835	1.832	1.850	2.113	1.724	2.145	1.232
2Y	1.840	0.90	1.828	1.824	1.842	2.230	1.797	2.230	1.225
3Y	1.810	0.80	1.798	1.801	1.815	2.315	1.777	2.315	1.200
4Y	1.880	1.00	1.865	1.869	1.888	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.880	1.00	1.865	1.872	1.887	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.989	1.50	1.972	1.978	1.979	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	2.015	2.30	1.993	1.992	1.998	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.080	2.40	2.050	2.050	2.015	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.89	0.00
CALL	1.76	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.109.20	#VALUE!	109.25	109.28	109.18
LKTb	126.80	-0.24	127.05	127.16	126.70

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	2.75	-0.60	1.93	1.11	2.13	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-0.60	-0.65	-1.54	-1.85	-1.98	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-2.75	-0.15	-3.74	-3.88	-3.48	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-3.00	0.20	-3.87	-4.46	-3.15	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.00	0.25	-11.59	-12.06	-10.76	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-11.50	0.50	-12.29	-12.60	-10.64	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.15	0.00	-22.40	-22.23	-18.72	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-20.25	-0.55	-20.12	-19.01	-15.72	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-24.50	-0.65	-23.49	-22.73	-16.49	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1125.20 (+1.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-53.75	-1.00	1Y	1.3300	-1.00	1.6200	0.9950	1*2Y	-16.00	1.00		
-59.50	-0.75	1.5Y	1.2450	-0.50	1.6600	1.0250	2*3Y	-2.50	0.00		
-64.25	-0.75	2Y	1.1700	0.00	1.6950	1.0450	2*5Y	-7.50	-0.50		
-63.50	-1.00	3Y	1.1450	0.00	1.7550	1.1100	3*4Y	-2.50	0.00		
-65.00	-1.25	4Y	1.1200	0.00	1.8000	1.0850	3*5Y	-5.00	-0.50		
-67.00	-2.00	5Y	1.0950	-0.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-2.50	-0.50		
-58.75	-2.00	7Y	1.1800	-0.50	1.8950	1.0950	5*7Y	8.50	0.00		
-49.75	-2.25	10Y	1.3150	-0.50	2.0500	1.2600	5*10Y	22.00	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	2.5286	0.0290	2.4996	2.4955	2.5203	2.9773	1.4750	2.9773	0.4100
10Y	2.6977	0.0548	2.6429	2.6384	2.6662	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	68.86	2	66.86	66.55	69.03	103.03	-53.43	103.03	-164.20
10Y	68.27	3.18	65.09	64.14	66.92	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	0.00	1.00	-1.00	-0.50	1.50	42.50	-1.00	62.75	-1.00
KTb 2*10Y	17.50	1.40	16.10	16.70	16.70	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	16.91	2.58	14.33	14.29	14.59	85.87	8.46	184.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	88.75								
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y					SPRD	2y*10y 0 / -1.25			
03Y	78					9y*10y 2			
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y 14.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	97 건	-38	135	110	63	53	46	82	
금 액	26,350 억원	-21,056	47,406	39,386	17,309	11,905	12,890	23,504	

장중동향

국고채 금리, 미중 무역협상 합의안 관련 양해 각서 작성 소식에 금리 상승 마감.

IRS, 미중 무역협상 진전에 금리 상승. 커브 스티프닝.
CD금리가 올라오면서 거래량은 단기 중심으로 조금 늘어.

CRS, 한산한 분위기 속에 금리 혼조. 일부 구간 금리 하락.