

IPS Daily Morning Brief

2019-02-26

종가 기준일 2019-02-25

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8875	0.25	1.8850	1.8608	1.8704	1.9125	1.4675	2.1175	1.2875
9M	1.8825	0.25	1.8800	1.8534	1.8612	1.9125	1.5325	2.1050	1.2500
1Y	1.8700	0.25	1.8660	1.8381	1.8472	1.9200	1.6000	2.0925	1.2200
1.5Y	1.8450	0.50	1.8380	1.8160	1.8300	2.0250	1.6875	2.1125	1.1900
2Y	1.8150	0.50	1.8080	1.7865	1.8055	2.1150	1.7325	2.1350	1.1675
3Y	1.7850	1.00	1.7750	1.7575	1.7802	2.2225	1.6975	2.2225	1.1550
4Y	1.7750	1.00	1.7645	1.7491	1.7757	2.2950	1.6900	2.2950	1.1575
5Y	1.7700	1.00	1.7580	1.7454	1.7750	2.3400	1.6825	2.3450	1.1575
7Y	1.7725	1.00	1.7610	1.7544	1.7857	2.3950	1.7000	2.4525	1.1675
10Y	1.8100	1.00	1.8020	1.7995	1.8338	2.4850	1.7525	2.5950	1.2125
12Y	1.8375	1.25	1.8275	1.8260	1.8584	2.5225	1.7750	2.6450	1.2150
15Y	1.8475	1.25	1.8375	1.8379	1.8697	2.5400	1.7950	2.7050	1.2150
20Y	1.8375	1.50	1.8255	1.8228	1.8428	2.5600	1.7500	2.8725	1.2150

6*9M	-0.50	0.00	-0.50	-0.74	-0.92	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.25	0.00	-1.40	-1.53	-1.40	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-5.50	0.25	-5.80	-5.16	-4.16	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.00	0.50	-3.30	-2.90	-2.54	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.00	0.50	-4.35	-3.74	-2.99	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-4.50	0.50	-5.00	-4.11	-3.05	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-1.00	0.00	-1.05	-0.84	-0.45	8.50	-1.25	11.25	-1.25
3*5Y	-1.50	0.00	-1.70	-1.21	-0.51	14.00	-2.25	22.00	-2.25
4*5Y	-0.50	0.00	-0.65	-0.38	-0.06	6.00	-1.00	10.75	-1.00
5*7Y	0.25	0.00	0.30	0.90	1.06	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	4.00	0.00	4.40	5.41	5.87	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	3.75	0.00	4.10	4.51	4.81	9.50	3.75	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.25	2.55	2.65	2.46	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.75	0.25	3.55	3.84	3.59	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	2.75	0.50	2.35	2.33	0.90	10.25	-1.50	28.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.851	0.80	1.840	1.826	1.823	1.935	1.570	2.130	1.237
1.5Y	1.852	0.60	1.843	1.833	1.847	2.113	1.724	2.145	1.232
2Y	1.845	0.70	1.837	1.825	1.839	2.230	1.797	2.230	1.225
3Y	1.820	1.00	1.808	1.802	1.812	2.315	1.777	2.315	1.200
4Y	1.887	0.70	1.876	1.870	1.884	2.502	1.837	2.502	1.232
5Y	1.892	1.20	1.877	1.872	1.883	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.995	1.30	1.983	1.977	1.976	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	2.015	1.30	2.004	1.992	1.993	2.815	1.923	2.815	1.355
20Y	2.075	-0.10	2.068	2.051	2.014	2.792	1.910	3.015	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.17	-0.04	109.22	109.23	109.17
LKTb	126.80	-0.10	126.91	127.00	126.77

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	1.90	-0.55	2.62	1.21	2.40	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-0.70	-0.10	-0.54	-1.68	-1.73	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-3.00	-0.20	-2.88	-3.82	-3.34	-0.25	-18.30	-0.25	-25.15
3Y	-3.50	0.00	-3.28	-4.40	-3.17	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.20	0.30	-11.19	-12.07	-10.85	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.20	-0.20	-11.94	-12.66	-10.81	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.25	-0.30	-22.20	-22.26	-19.04	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-20.50	-0.30	-20.22	-19.23	-15.97	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-23.75	1.60	-24.23	-22.79	-17.13	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1121.00 (-4.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-55.00	-1.25	1Y	1.3200	-1.00	1.6200	0.9950	1*2Y	-17.50	-0.50		
-61.00	-1.50	1.5Y	1.2350	-1.00	1.6600	1.0250	2*3Y	-3.00	0.00		
-67.00	-2.00	2Y	1.1450	-1.50	1.6950	1.0450	2*5Y	-8.50	-0.50		
-67.00	-2.50	3Y	1.1150	-1.50	1.7550	1.1100	3*4Y	-2.50	0.00		
-68.50	-2.50	4Y	1.0900	-1.50	1.8000	1.0850	3*5Y	-5.50	-0.50		
-71.00	-3.00	5Y	1.0600	-2.00	1.8500	1.0400	4*5Y	-3.00	-0.50		
-63.25	-3.00	7Y	1.1400	-2.00	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.00		
-53.50	-3.00	10Y	1.2750	-2.00	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	2.5037	0.0125	2.4912	2.5286	2.4996	2.9773	1.4750	2.9773	0.4100
10Y	2.6626	0.0081	2.6545	2.6977	2.6429	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	65.87	0.55	65.32	68.86	66.86	103.03	-53.43	103.03	-164.20
10Y	64.76	-0.49	65.25	68.27	65.09	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	0.50	-1.00	0.00	-1.00	42.50	-1.00	62.75	-1.00
KTb 2*10Y	17.00	0.60	16.40	17.50	16.10	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	15.89	-0.44	16.33	16.91	14.33	85.87	8.46	184.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	81 / 81.25				SPRD	8*9*10Y -01			
03Y									
04Y	76.75								
05Y	75.75 / 76 / 76.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y CCS 33.5 / 2y CCS 15 / 3y CCS 11.5 / 4y CCS 09 2*4y CCS -5.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	58 건	24	34	97	135	110	63	53	
금 액	14,759 억원	-2,976	17,735	26,350	47,406	39,386	17,309	11,905	

장중동향
국고채 금리, 미중 무역협상에 대한 낙관적 기대가 커지면서 위험 선호 심리가 살아나 금리 상승 마감.

IRS, 중장기 구간을 중심으로 금리가 상승하면서 커브 스티프닝.

CRS, 애셋스왑 영향으로 금리 전 구간 하락.