

IPS Daily Morning Brief

2019-01-08

종가 기준일 2019-01-07

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8525	0.00	1.8835	1.8901	1.8236	1.9125	1.4125	2.2825	1.2875
9M	1.8325	0.25	1.8635	1.8756	1.8400	1.9125	1.4550	2.2625	1.2500
1Y	1.8075	0.75	1.8390	1.8590	1.8501	1.9200	1.5000	2.2425	1.2200
1.5Y	1.7825	1.25	1.8135	1.8414	1.8643	2.0250	1.5550	2.2725	1.1900
2Y	1.7500	1.75	1.7765	1.8141	1.8715	2.1150	1.6000	2.3125	1.1675
3Y	1.7275	3.00	1.7440	1.7830	1.8820	2.2225	1.6750	2.4000	1.1550
4Y	1.7175	2.75	1.7380	1.7781	1.9000	2.2950	1.6900	2.5025	1.1575
5Y	1.7125	3.00	1.7325	1.7776	1.9165	2.3400	1.6825	2.5875	1.1575
7Y	1.7275	2.75	1.7470	1.7878	1.9414	2.3950	1.7000	2.7000	1.1675
10Y	1.7800	2.75	1.7980	1.8369	2.0000	2.4850	1.7525	2.8425	1.2125
12Y	1.8025	2.75	1.8195	1.8580	2.0268	2.5225	1.7750	2.8950	1.2150
15Y	1.8225	2.75	1.8380	1.8671	2.0327	2.5400	1.7950	2.9475	1.2150
20Y	1.7775	2.75	1.7955	1.8360	2.0222	2.5600	1.7500	3.0675	1.2150

6*9M	-2.00	0.25	-2.00	-1.45	1.64	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-2.50	0.50	-2.45	-1.66	1.02	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-5.75	1.00	-6.25	-4.49	2.14	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.25	1.25	-3.25	-3.11	1.04	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-3.25	1.00	-3.85	-3.60	2.85	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-3.75	1.25	-4.40	-3.65	4.50	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-1.00	-0.25	-0.60	-0.49	1.81	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	-1.50	0.00	-1.15	-0.54	3.45	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	-0.50	0.25	-0.55	-0.05	1.65	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	1.50	-0.25	1.45	1.01	2.49	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	6.75	-0.25	6.55	5.93	8.35	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	5.25	0.00	5.10	4.91	5.86	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.25	0.00	2.15	2.11	2.67	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.00	3.03	3.27	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	-0.25	0.00	-0.25	-0.09	2.22	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.770	-0.10	1.791	1.823	1.864	1.935	1.451	2.250	1.237
1.5Y	1.810	0.10	1.828	1.858	1.909	2.113	1.585	2.280	1.232
2Y	1.810	1.00	1.823	1.841	1.917	2.230	1.675	2.310	1.225
3Y	1.807	1.20	1.805	1.806	1.905	2.315	1.737	2.370	1.200
4Y	1.877	1.50	1.875	1.883	1.994	2.502	1.849	2.581	1.232
5Y	1.880	1.50	1.878	1.878	2.009	2.602	1.825	2.660	1.217
7Y	1.974	1.30	1.964	1.957	2.096	2.728	1.913	2.855	1.270
10Y	1.980	1.30	1.963	1.972	2.147	2.815	1.923	3.057	1.355
20Y	1.975	0.00	1.978	1.962	2.108	2.792	1.910	3.240	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.75	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.28	-0.05	109.26	109.33	109.25
LKTB	127.08	-0.15	126.95	127.24	126.95

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	3.75	0.85	4.82	3.59	-1.39	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-2.75	1.15	-1.45	-1.62	-4.42	0.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-6.00	0.75	-4.67	-2.73	-4.56	-0.25	-18.30	1.80	-25.15
3Y	-7.95	1.80	-6.08	-2.28	-2.32	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-15.95	1.25	-13.68	-10.51	-9.35	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-16.75	1.50	-14.55	-10.08	-9.21	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-24.65	1.45	-21.66	-16.88	-15.46	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-20.00	1.45	-16.50	-13.55	-14.72	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-19.75	2.75	-18.21	-12.56	-8.56	1.75	-34.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1118.60 (-5.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-50.25	7.75	1Y	1.3050	8.50	1.6200	0.8800	1*2Y	-15.00	-4.00		
-55.25	5.75	1.5Y	1.2300	7.00	1.6600	0.9050	2*3Y	-2.00	-2.00		
-59.50	2.75	2Y	1.1550	4.50	1.6950	0.9200	2*5Y	-4.00	-2.00		
-59.25	-0.50	3Y	1.1350	2.50	1.7550	0.9850	3*4Y	-1.50	-0.50		
-59.75	-0.75	4Y	1.1200	2.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-2.00	0.00		
-59.75	-0.50	5Y	1.1150	2.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-0.50	0.50		
-49.75	-0.25	7Y	1.2300	2.50	1.8950	1.0950	5*7Y	11.50	0.00		
-38.00	-0.75	10Y	1.4000	2.00	2.0500	1.2600	5*10Y	28.50	-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	2.5406	0.0489	2.4917	2.3866	2.4838	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.6975	0.0293	2.6682	2.5549	2.6198	3.2382	2.0387	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	73.06	3.89	69.17	56.56	65.28	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	71.75	1.63	70.12	59.29	66.98	98.82	-24.46	98.82	-63.50

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	3.00	1.00	2.00	1.50	3.00	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	17.00	0.30	16.70	14.10	11.90	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	15.69	-1.96	17.65	16.83	13.60	92.41	8.46	205.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor	6Y 71.5				
06M	85.5									
09M										
01Y										
1.5Y										
02Y	74.5				SPRD	1*3Y -08				
03Y	72 / 72.75					9*10Y 2.25				
04Y	71.5					10*12Y 2.5				
05Y	70.5 / 70.75					10*20Y -0.25				
07Y										
10Y	77									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	1y CCS 30									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			113 건	-55	168	137	63	90	57	51
금 액			30,760 억원	-15,120	45,880	36,889	20,112	36,745	14,805	24,783

장중동향
국고채 금리, 금리 상승.
전 거래일 미 금리 상승에 연동했지만 외인의 선물매수 등 요인에 상승폭 제한.

IRS, 미 금리 급등 영향에 금리 상승 마감.
최근 강했던 외은 오피가 사라지도 비디쉬 했던 모습.

CRS, 전 구간 금리 상승.