

IPS Daily Morning Brief

2019-01-09

종가 기준일 2019-01-08

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8575	0.50	1.8725	1.8885	1.8252	1.9125	1.4125	2.2825	1.2875
9M	1.8400	0.75	1.8525	1.8736	1.8403	1.9125	1.4550	2.2625	1.2500
1Y	1.8175	1.00	1.8275	1.8558	1.8495	1.9200	1.5000	2.2425	1.2200
1.5Y	1.7950	1.25	1.8020	1.8373	1.8623	2.0250	1.5550	2.2625	1.1900
2Y	1.7675	1.75	1.7665	1.8098	1.8683	2.1150	1.6000	2.3000	1.1675
3Y	1.7475	2.00	1.7365	1.7788	1.8776	2.2225	1.6750	2.3875	1.1550
4Y	1.7425	2.50	1.7310	1.7740	1.8948	2.2950	1.6900	2.4875	1.1575
5Y	1.7425	3.00	1.7265	1.7730	1.9107	2.3400	1.6825	2.5725	1.1575
7Y	1.7575	3.00	1.7415	1.7839	1.9353	2.3950	1.7000	2.6850	1.1675
10Y	1.8075	2.75	1.7935	1.8335	1.9937	2.4850	1.7525	2.8250	1.2125
12Y	1.8300	2.75	1.8155	1.8548	2.0202	2.5225	1.7750	2.8775	1.2150
15Y	1.8475	2.50	1.8350	1.8648	2.0263	2.5400	1.7950	2.9300	1.2150
20Y	1.8025	2.50	1.7915	1.8320	2.0151	2.5600	1.7500	3.0600	1.2150

6*9M	-1.75	0.25	-2.00	-1.49	1.51	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-2.25	0.25	-2.50	-1.79	0.91	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-5.00	0.75	-6.10	-4.60	1.88	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.00	0.25	-3.00	-3.10	0.93	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-2.50	0.75	-3.55	-3.58	2.65	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-2.50	1.25	-4.00	-3.68	4.24	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.50	0.50	-0.55	-0.48	1.73	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	-0.50	1.00	-1.00	-0.57	3.31	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	0.00	0.50	-0.45	-0.10	1.59	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	1.50	0.00	1.50	1.09	2.46	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	6.50	-0.25	6.70	6.05	8.30	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	5.00	-0.25	5.20	4.96	5.84	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.25	0.00	2.20	2.13	2.65	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	-0.25	4.15	3.13	3.27	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	-0.50	-0.25	-0.20	-0.15	2.14	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.773	0.30	1.778	1.818	1.862	1.935	1.451	2.240	1.237
1.5Y	1.815	0.50	1.818	1.854	1.906	2.113	1.585	2.270	1.232
2Y	1.820	1.00	1.816	1.839	1.914	2.230	1.675	2.305	1.225
3Y	1.811	0.40	1.802	1.805	1.902	2.315	1.737	2.370	1.200
4Y	1.895	1.80	1.876	1.884	1.989	2.502	1.849	2.567	1.232
5Y	1.895	1.50	1.879	1.879	2.004	2.602	1.825	2.647	1.217
7Y	1.988	1.40	1.968	1.959	2.091	2.728	1.913	2.840	1.270
10Y	1.992	1.20	1.970	1.973	2.141	2.815	1.923	3.032	1.355
20Y	1.990	1.50	1.980	1.964	2.103	2.792	1.910	3.211	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.74	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.23	-0.05	109.28	109.33	109.22
LKTB	126.90	-0.18	127.02	127.18	126.80

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	4.45	0.70	4.91	3.75	-1.28	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-2.00	0.75	-1.64	-1.69	-4.36	0.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-5.25	0.75	-4.99	-2.97	-4.59	-0.25	-18.30	1.80	-25.15
3Y	-6.35	1.60	-6.59	-2.58	-2.41	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-15.25	0.70	-14.48	-10.96	-9.45	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-15.25	1.50	-15.21	-10.62	-9.28	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-23.05	1.60	-22.69	-17.51	-15.56	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-18.45	1.55	-17.67	-13.94	-14.74	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-18.75	1.00	-18.87	-13.21	-8.76	1.75	-34.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1124.10 (+5.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-50.25	0.00	1Y	1.3150	1.00	1.6200	0.8900	1*2Y	-15.00	0.00		
-55.50	-0.25	1.5Y	1.2400	1.00	1.6600	0.9050	2*3Y	-1.50	0.50		
-60.25	-0.75	2Y	1.1650	1.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-3.50	0.50		
-59.75	-0.50	3Y	1.1500	1.50	1.7550	0.9850	3*4Y	-1.50	0.00		
-60.75	-1.00	4Y	1.1350	1.50	1.8000	1.0700	3*5Y	-2.00	0.00		
-61.25	-1.50	5Y	1.1300	1.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-0.50	0.00		
-51.25	-1.50	7Y	1.2450	1.50	1.8950	1.0950	5*7Y	11.50	0.00		
-39.25	-1.25	10Y	1.4150	1.50	2.0500	1.2600	5*10Y	28.50	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	2.5896	0.0490	2.5406	2.4917	2.3866	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7321	0.0346	2.6975	2.6682	2.5549	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	76.96	3.9	73.06	69.17	56.56	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	74.01	2.26	71.75	70.12	59.29	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	4.00	1.00	3.00	2.00	1.50	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	17.20	0.20	17.00	16.70	14.10	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	14.25	-1.44	15.69	17.65	16.83	89.29	8.46	205.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	79.5								
02Y									
03Y									
04Y	72							2*3y -2.5	
05Y	71.25							4*5y 00	
07Y	73.5 / 74							5*10y 6.5	
10Y	77.75 / 78 / 78.25 / 78.5/ 80								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y 31								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			98 건	-15	113	168	137	63	90
금 액			22,502 억원	-8,258	30,760	45,880	36,889	20,112	36,745
									14,805

장중동향
국고채 금리 상승.
오전에는 개인의 매수로 강세를 보이고, 오후들어 외국인의 매도로 약세 전환하며 변동성 지속. 금리상승에는 미국금리상승의 영향이 컸다.

IRS는 전구간 상승.
커브는 스프레드 비드가 많아 스티프닝 마감.

CRS도 전구간 상승 마감.