

IPS Daily Morning Brief

2019-01-10

종가 기준일 2019-01-09

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8600	0.25	1.8635	1.8870	1.8263	1.9125	1.4125	2.2825	1.2875
9M	1.8425	0.25	1.8440	1.8716	1.8402	1.9125	1.4550	2.2625	1.2500
1Y	1.8225	0.50	1.8195	1.8529	1.8483	1.9200	1.5000	2.2425	1.2200
1.5Y	1.8025	0.75	1.7950	1.8339	1.8598	2.0250	1.5550	2.2600	1.1900
2Y	1.7775	1.00	1.7625	1.8061	1.8648	2.1150	1.6000	2.2950	1.1675
3Y	1.7575	1.00	1.7350	1.7758	1.8729	2.2225	1.6750	2.3800	1.1550
4Y	1.7550	1.25	1.7295	1.7710	1.8894	2.2950	1.6900	2.4775	1.1575
5Y	1.7550	1.25	1.7255	1.7698	1.9047	2.3400	1.6825	2.5575	1.1575
7Y	1.7650	0.75	1.7395	1.7809	1.9288	2.3950	1.7000	2.6725	1.1675
10Y	1.8125	0.50	1.7905	1.8304	1.9869	2.4850	1.7525	2.8150	1.2125
12Y	1.8375	0.75	1.8135	1.8519	2.0133	2.5225	1.7750	2.8725	1.2150
15Y	1.8550	0.75	1.8325	1.8628	2.0196	2.5400	1.7950	2.9275	1.2150
20Y	1.8100	0.75	1.7880	1.8284	2.0076	2.5600	1.7500	3.0600	1.2150

6*9M	-1.75	0.00	-1.95	-1.54	1.39	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-2.00	0.25	-2.45	-1.88	0.81	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-4.50	0.50	-5.70	-4.68	1.64	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.00	0.00	-2.75	-3.04	0.82	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-2.25	0.25	-3.30	-3.51	2.46	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-2.25	0.25	-3.70	-3.64	3.99	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.25	0.25	-0.55	-0.48	1.65	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	-0.25	0.25	-0.95	-0.60	3.18	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	0.00	0.00	-0.40	-0.12	1.53	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	1.00	-0.50	1.40	1.11	2.42	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.75	-0.75	6.50	6.06	8.23	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.75	-0.25	5.10	4.95	5.81	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.25	2.30	2.15	2.63	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.25	4.20	3.24	3.27	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	-0.25	0.25	-0.25	-0.20	2.07	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	0.00	1.774	1.814	1.860	1.935	1.451	2.230	1.237
1.5Y	1.815	0.00	1.814	1.851	1.903	2.113	1.585	2.265	1.232
2Y	1.821	0.10	1.814	1.837	1.911	2.230	1.675	2.305	1.225
3Y	1.805	-0.60	1.804	1.803	1.898	2.315	1.737	2.370	1.200
4Y	1.887	-0.80	1.879	1.883	1.985	2.502	1.849	2.560	1.232
5Y	1.888	-0.70	1.881	1.879	1.998	2.602	1.825	2.637	1.217
7Y	1.978	-1.00	1.973	1.961	2.085	2.728	1.913	2.835	1.270
10Y	1.979	-1.30	1.976	1.972	2.134	2.815	1.923	3.030	1.355
20Y	1.990	0.00	1.983	1.966	2.097	2.792	1.910	3.195	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.23	0.00	109.22	109.24	109.18
LKTb	126.95	0.05	126.77	126.95	126.57

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	4.95	0.50	4.55	3.91	-1.20	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-1.25	0.75	-1.92	-1.67	-4.31	0.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-4.35	0.90	-5.19	-3.13	-4.63	-0.25	-18.30	1.80	-25.15
3Y	-4.75	1.60	-6.90	-2.75	-2.47	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-13.20	2.05	-14.97	-11.24	-9.52	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-13.30	1.95	-15.57	-10.95	-9.32	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.30	1.75	-23.35	-17.97	-15.62	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.65	1.80	-18.55	-14.16	-14.71	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-18.00	0.75	-19.50	-13.74	-8.95	1.75	-34.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1122.10 (-2.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-47.75	2.50	1Y	1.3450	3.00	1.6200	0.8900	1*2Y	-16.50	-1.50		
-54.25	1.25	1.5Y	1.2600	2.00	1.6600	0.9050	2*3Y	-2.00	-0.50		
-59.75	0.50	2Y	1.1800	1.50	1.6950	0.9200	2*5Y	-2.50	1.00		
-59.75	0.00	3Y	1.1600	1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-0.50	1.00		
-60.00	0.75	4Y	1.1550	2.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-0.50	1.50		
-60.00	1.25	5Y	1.1550	2.50	1.8500	1.0400	4*5Y	0.00	0.50		
-52.00	-0.75	7Y	1.2450	0.00	1.8950	1.0950	5*7Y	9.00	-2.50		
-42.25	-3.00	10Y	1.3900	-2.50	2.0500	1.2600	5*10Y	23.50	-5.00		

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	2.5611	-0.0285	2.5896	2.5406	2.4917	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7115	-0.0206	2.7321	2.6975	2.6682	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	74.01	-2.95	76.96	73.06	69.17	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	73.25	-0.76	74.01	71.75	70.12	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	3.50	-0.50	4.00	3.00	2.00	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	15.80	-1.40	17.20	17.00	16.70	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	15.04	0.79	14.25	15.69	17.65	88.71	8.46	205.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	80								
02Y	78.5	SPRD	5*10Y 7.25						
03Y	75.5								
04Y									
05Y	76.75								
07Y									
10Y	82.25 / 83.5								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	137 건	39	98	113	168	137	63	90	
금 액	43,641 억원	21,139	22,502	30,760	45,880	36,889	20,112	36,745	

장중동향
국고채 금리, 보험권에서 혼조세로 마감.
미·중 무역협상 진전에 대한 기대로 증시가 강세를 보인 데다 외인이 국채선물과 현물을 대량으로 매도한 영향으로 커졌던 금리 오름폭이 장 막판 되돌려짐.

IRS, 국채선물에 연동되며 전 구간에서 금리 상승.

CRS, 중단기 구간을 위주로 금리 상승.