

IPS Daily Morning Brief

2019-01-16

종가 기준일 2019-01-15

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8500	0.00	1.8555	1.8798	1.8306	1.9125	1.4125	2.2825	1.2875
9M	1.8375	0.00	1.8415	1.8645	1.8404	1.9125	1.4550	2.2625	1.2500
1Y	1.8200	0.00	1.8230	1.8454	1.8445	1.9200	1.5000	2.2425	1.2200
1.5Y	1.7925	-0.25	1.8005	1.8240	1.8513	2.0250	1.5550	2.2550	1.1900
2Y	1.7675	-0.25	1.7750	1.7949	1.8521	2.1150	1.6000	2.2775	1.1675
3Y	1.7375	-0.25	1.7515	1.7649	1.8559	2.2225	1.6750	2.3525	1.1550
4Y	1.7300	-1.25	1.7510	1.7609	1.8698	2.2950	1.6900	2.4375	1.1575
5Y	1.7275	-1.50	1.7515	1.7584	1.8830	2.3400	1.6825	2.5050	1.1575
7Y	1.7350	-1.50	1.7595	1.7684	1.9055	2.3950	1.7000	2.6175	1.1675
10Y	1.7775	-2.00	1.8045	1.8161	1.9624	2.4850	1.7525	2.7600	1.2125
12Y	1.8025	-2.00	1.8295	1.8386	1.9883	2.5225	1.7750	2.8225	1.2150
15Y	1.8175	-2.00	1.8460	1.8519	1.9954	2.5400	1.7950	2.8900	1.2150
20Y	1.7750	-2.00	1.8020	1.8116	1.9805	2.5600	1.7500	3.0325	1.2150

6*9M	-1.25	0.00	-1.40	-1.53	0.98	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.75	0.00	-1.85	-1.91	0.41	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-5.25	-0.25	-4.80	-5.05	0.76	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.00	0.00	-2.35	-3.00	0.38	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-3.75	-1.00	-2.40	-3.40	1.78	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-4.00	-1.25	-2.35	-3.65	3.09	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.75	-1.00	-0.05	-0.40	1.39	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	-1.00	-1.25	0.00	-0.65	2.71	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	-0.25	-0.25	0.05	-0.25	1.32	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	0.75	0.00	0.80	1.00	2.25	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.00	-0.50	5.30	5.78	7.94	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.25	-0.50	4.50	4.78	5.70	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.00	2.50	2.25	2.58	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.15	3.57	3.30	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	-0.25	0.00	-0.25	-0.45	1.81	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.801	-0.10	1.789	1.804	1.853	1.935	1.451	2.215	1.237
1.5Y	1.830	0.50	1.822	1.841	1.893	2.113	1.585	2.250	1.232
2Y	1.825	0.00	1.823	1.833	1.899	2.230	1.675	2.287	1.225
3Y	1.792	-0.50	1.798	1.803	1.883	2.315	1.737	2.330	1.200
4Y	1.860	-0.20	1.869	1.878	1.967	2.502	1.849	2.502	1.232
5Y	1.855	0.00	1.866	1.873	1.976	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.954	-0.50	1.966	1.960	2.064	2.728	1.913	2.780	1.270
10Y	1.962	-1.00	1.974	1.967	2.109	2.815	1.923	2.970	1.355
20Y	1.997	-0.30	1.994	1.972	2.079	2.792	1.910	3.130	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.73	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.31	0.00	109.30	109.32	109.27
LKTb	127.35	0.10	127.20	127.37	127.15

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	1.90	0.10	3.40	4.13	-0.88	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-3.75	-0.75	-2.15	-1.69	-4.17	0.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-5.75	-0.25	-4.78	-3.79	-4.70	-0.25	-18.30	1.80	-25.15
3Y	-5.45	0.25	-4.61	-3.85	-2.68	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-13.00	-1.05	-11.82	-11.66	-9.70	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.75	-1.50	-11.41	-11.42	-9.34	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.90	-1.00	-20.61	-19.20	-15.84	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-18.45	-1.00	-16.91	-15.10	-14.68	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-22.20	-1.70	-19.24	-15.99	-9.84	1.75	-34.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1120.70 (-2.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-49.50	2.00	1Y	1.3250	2.00	1.6200	0.8900	1*2Y	-14.00	-1.00		
-53.75	1.75	1.5Y	1.2550	1.50	1.6600	0.9050	2*3Y	-2.50	-0.50		
-58.25	1.25	2Y	1.1850	1.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-0.50	0.00		
-57.75	0.75	3Y	1.1600	0.50	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	0.50		
-56.00	2.25	4Y	1.1700	1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	2.00	0.50		
-54.75	2.50	5Y	1.1800	1.00	1.8500	1.0400	4*5Y	1.00	0.00		
-48.00	2.50	7Y	1.2550	1.00	1.8950	1.0950	5*7Y	7.50	0.00		
-38.75	2.50	10Y	1.3900	0.50	2.0500	1.2600	5*10Y	21.00	-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	2.5326	-0.0041	2.5367	2.5490	2.5775	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7180	0.0142	2.7038	2.7021	2.7471	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	70.76	-0.41	71.17	72.20	76.15	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	75.60	2.42	73.18	70.71	78.71	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	1.00	-1.75	2.75	5.50	2.00	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	13.70	-1.00	14.70	16.80	14.40	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	18.54	1.83	16.71	15.31	16.96	86.53	8.46	199.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	8Y 75.75						
06M									
09M	84								
01Y	82.5								
1.5Y									
02Y	77	SPRD	9m*3Y -10						
03Y	73.75		3*5Y -0.75						
04Y			5*10Y 05 / 5.5						
05Y			10*15Y 04						
07Y									
10Y	77.75/78/79.5/79.75/80								
12Y	81.25								
15Y									
20Y									
CRS	1y CCS 30.5								
	3*4y CCS 01								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	147 건	47	100	85	85	137	98	113	
금 액	38,558 억원	20,087	18,471	23,400	22,745	43,641	22,502	30,760	

장중동향
국고채 금리, 브렉시트 불확실성에 소폭 하락 마감.
영국 국회의 브렉시트 합의안 승인 투표를 앞둔 불확실성과 미 연방 정부 섣다른, 국내외 경제 지표 부진 등 채권 강세 요인 작용.

IRS, 브렉시트 관련 불확실성에 전 구간 금리 하락.
10Y 이상 장기 구간에서 기본되면서 레벨이 내려오는 모습.

CRS, 전 구간 금리 상승.