

IPS Daily Morning Brief

2019-01-18

종가 기준일 2019-01-17

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8550	0.25	1.8535	1.8755	1.8324	1.9125	1.4125	2.2825	1.2875
9M	1.8450	0.50	1.8415	1.8606	1.8405	1.9125	1.4550	2.2625	1.2500
1Y	1.8250	0.25	1.8235	1.8416	1.8428	1.9200	1.5000	2.2425	1.2200
1.5Y	1.8025	0.50	1.7995	1.8194	1.8473	2.0250	1.5550	2.2550	1.1900
2Y	1.7825	0.75	1.7760	1.7899	1.8461	2.1150	1.6000	2.2750	1.1675
3Y	1.7575	0.75	1.7510	1.7605	1.8478	2.2225	1.6750	2.3400	1.1550
4Y	1.7500	0.75	1.7485	1.7560	1.8602	2.2950	1.6900	2.4150	1.1575
5Y	1.7500	1.00	1.7485	1.7531	1.8723	2.3400	1.6825	2.4750	1.1575
7Y	1.7575	1.00	1.7565	1.7628	1.8937	2.3950	1.7000	2.5825	1.1675
10Y	1.8025	1.25	1.8015	1.8098	1.9500	2.4850	1.7525	2.7150	1.2125
12Y	1.8275	1.25	1.8265	1.8326	1.9757	2.5225	1.7750	2.7875	1.2150
15Y	1.8425	1.25	1.8420	1.8466	1.9833	2.5400	1.7950	2.8575	1.2150
20Y	1.7975	1.00	1.7985	1.8046	1.9668	2.5600	1.7500	3.0000	1.2150

6*9M	-1.00	0.25	-1.20	-1.49	0.82	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-2.00	-0.25	-1.80	-1.90	0.23	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-4.25	0.50	-4.75	-5.18	0.33	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.50	0.00	-2.50	-2.94	0.17	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-3.25	0.00	-2.75	-3.39	1.41	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-3.25	0.25	-2.75	-3.68	2.61	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.75	0.00	-0.25	-0.45	1.24	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	-0.75	0.25	-0.25	-0.74	2.45	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	0.00	0.25	0.00	-0.29	1.20	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	0.75	0.00	0.80	0.96	2.15	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.25	0.25	5.30	5.66	7.77	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.50	0.25	4.50	4.70	5.63	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.00	2.50	2.29	2.58	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.05	3.69	3.33	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	-0.50	-0.25	-0.30	-0.51	1.69	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.804	0.00	1.801	1.801	1.851	1.935	1.451	2.215	1.237
1.5Y	1.832	0.00	1.829	1.837	1.889	2.113	1.585	2.250	1.232
2Y	1.825	0.00	1.825	1.831	1.894	2.230	1.675	2.282	1.225
3Y	1.800	0.30	1.798	1.805	1.876	2.315	1.737	2.322	1.200
4Y	1.875	0.80	1.868	1.875	1.959	2.502	1.849	2.502	1.232
5Y	1.875	0.80	1.865	1.871	1.967	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.972	0.50	1.967	1.961	2.054	2.728	1.913	2.733	1.270
10Y	1.977	0.20	1.976	1.965	2.097	2.815	1.923	2.920	1.355
20Y	2.015	1.50	2.003	1.975	2.070	2.792	1.910	3.085	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.75	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.29	0.00	109.29	109.32	109.26
LKTb	127.20	-0.05	127.20	127.31	127.09

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	2.10	0.25	2.29	4.04	-0.80	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-2.95	0.50	-2.93	-1.75	-4.22	0.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-4.25	0.75	-4.94	-4.10	-4.78	-0.25	-18.30	1.80	-25.15
3Y	-4.25	0.45	-4.66	-4.43	-2.84	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-12.50	-0.05	-11.97	-11.93	-9.88	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.50	0.20	-11.69	-11.80	-9.47	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.45	0.50	-21.05	-19.79	-16.06	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-17.45	1.05	-17.47	-15.49	-14.73	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-21.75	-0.50	-20.49	-17.06	-10.32	1.75	-34.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1122.50 (+2.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-51.50	-0.75	1Y	1.3100	-0.50	1.6200	0.8900	1*2Y	-13.50	-0.50		
-56.25	-1.00	1.5Y	1.2400	-0.50	1.6600	0.9050	2*3Y	-2.50	0.00		
-60.75	-1.75	2Y	1.1750	-1.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-1.50	-0.50		
-60.75	-1.75	3Y	1.1500	-1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	1.00	0.00		
-59.00	-1.75	4Y	1.1600	-1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	1.00	-0.50		
-59.00	-2.50	5Y	1.1600	-1.50	1.8500	1.0400	4*5Y	0.00	-0.50		
-52.75	-3.00	7Y	1.2300	-2.00	1.8950	1.0950	5*7Y	7.00	-0.50		
-43.75	-2.75	10Y	1.3650	-1.50	2.0500	1.2600	5*10Y	20.50	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	2.5657	0.0207	2.5450	2.5326	2.5367	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7518	0.0276	2.7242	2.7180	2.7038	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	74.07	2.07	72.00	70.76	71.17	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	77.48	2.56	74.92	75.60	73.18	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	2.00	0.50	1.50	1.00	2.75	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	15.20	0.20	15.00	13.70	14.70	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	18.61	0.69	17.92	18.54	16.71	85.87	8.46	196.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS		ODD Tenor	6y 74.75							
06M										
09M										
01Y	82.25									
1.5Y										
02Y	78									
03Y			SPRD	9m*1Y -2						
04Y	74.75			9m*2Y -0.25						
05Y				1*2Y -4.5						
07Y				2*9Y -0.25						
10Y		2*20Y 1.5								
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6		
거래현황	103 건	-13	116	147	100	85	85	137		
금 액	51,818 억원	17,181	34,637	38,558	18,471	23,400	22,745	43,641		

장종등항

국고채 금리, 보험세 마감. 박스 등락.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.

CRS, 부채스왑 소강 영향으로 금리 하락.