

IPS Daily Morning Brief

2019-01-22

종가 기준일 2019-01-21

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8575	0.00	1.8545	1.8720	1.8343	1.9125	1.4125	2.2700	1.2875
9M	1.8525	0.25	1.8450	1.8581	1.8410	1.9125	1.4550	2.2475	1.2500
1Y	1.8450	0.75	1.8300	1.8404	1.8416	1.9200	1.5000	2.2250	1.2200
1.5Y	1.8350	1.25	1.8100	1.8193	1.8443	2.0250	1.5550	2.2350	1.1900
2Y	1.8200	1.25	1.7905	1.7908	1.8415	2.1150	1.6000	2.2525	1.1675
3Y	1.8025	1.25	1.7675	1.7635	1.8413	2.2225	1.6750	2.3150	1.1550
4Y	1.7950	1.25	1.7600	1.7586	1.8524	2.2950	1.6900	2.3875	1.1575
5Y	1.7975	1.25	1.7600	1.7564	1.8634	2.3400	1.6825	2.4475	1.1575
7Y	1.8100	1.50	1.7690	1.7661	1.8840	2.3950	1.7000	2.5550	1.1675
10Y	1.8600	1.75	1.8145	1.8131	1.9396	2.4850	1.7525	2.6950	1.2125
12Y	1.8850	1.75	1.8395	1.8363	1.9653	2.5225	1.7750	2.7675	1.2150
15Y	1.9000	1.75	1.8545	1.8510	1.9734	2.5400	1.7950	2.8450	1.2150
20Y	1.8550	1.75	1.8105	1.8078	1.9552	2.5600	1.7500	2.9925	1.2150

6*9M	-0.50	0.25	-0.95	-1.39	0.67	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-0.75	0.50	-1.50	-1.78	0.07	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-2.50	0.50	-3.95	-4.96	-0.01	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-1.75	0.00	-2.30	-2.73	-0.02	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-2.50	0.00	-3.05	-3.21	1.09	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-2.25	0.00	-3.05	-3.44	2.19	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.75	0.00	-0.75	-0.49	1.11	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	-0.50	0.00	-0.75	-0.71	2.22	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	0.25	0.00	0.00	-0.23	1.10	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	1.25	0.25	0.90	0.98	2.06	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	6.25	0.50	5.45	5.68	7.62	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	5.00	0.25	4.55	4.70	5.56	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.00	2.50	2.31	2.57	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.00	3.79	3.38	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	-0.50	0.00	-0.40	-0.54	1.56	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.816	0.40	1.807	1.802	1.848	1.935	1.451	2.200	1.237
1.5Y	1.838	0.30	1.833	1.835	1.886	2.113	1.585	2.230	1.232
2Y	1.832	-0.30	1.828	1.832	1.889	2.230	1.675	2.250	1.225
3Y	1.820	0.50	1.805	1.808	1.870	2.315	1.737	2.315	1.200
4Y	1.892	0.20	1.877	1.878	1.952	2.502	1.849	2.502	1.232
5Y	1.897	0.20	1.878	1.877	1.959	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	2.011	1.10	1.981	1.968	2.047	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	2.030	1.80	1.991	1.972	2.088	2.815	1.923	2.862	1.355
20Y	2.075	3.50	2.025	1.988	2.064	2.792	1.910	3.042	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.21	-0.01	109.21	109.24	109.19
LKTb	126.62	-0.18	126.70	126.86	126.62

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	2.90	0.35	2.26	3.84	-0.66	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-0.30	0.95	-2.34	-1.59	-4.17	0.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-1.20	1.55	-3.79	-4.10	-4.73	-0.25	-18.30	1.80	-25.15
3Y	-1.75	0.75	-3.73	-4.45	-2.90	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-9.70	1.05	-11.68	-11.98	-9.98	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.95	1.05	-11.78	-12.05	-9.56	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-20.10	0.40	-21.18	-20.21	-16.27	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-17.00	-0.05	-17.67	-15.90	-14.82	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-22.00	-1.75	-21.49	-18.02	-10.84	1.75	-34.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1128.10 (+6.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-51.50	-0.75	1Y	1.3300	0.00	1.6200	0.8900	1*2Y	-13.50	0.00		
-57.50	-1.25	1.5Y	1.2600	0.00	1.6600	0.9050	2*3Y	-2.50	0.00		
-62.50	-1.25	2Y	1.1950	0.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-2.50	0.00		
-63.25	-1.25	3Y	1.1700	0.00	1.7550	0.9850	3*4Y	0.00	0.00		
-62.50	-1.25	4Y	1.1700	0.00	1.8000	1.0700	3*5Y	0.00	0.00		
-62.75	-1.25	5Y	1.1700	0.00	1.8500	1.0400	4*5Y	0.00	0.00		
-58.00	-1.50	7Y	1.2300	0.00	1.8950	1.0950	5*7Y	6.00	0.00		
-49.50	-1.75	10Y	1.3650	0.00	2.0500	1.2600	5*10Y	19.50	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	2.6201	0.0000	2.6201	2.5657	2.5450	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7856	0.0000	2.7856	2.7518	2.7242	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	78.81	0.3	78.51	74.07	72.00	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	75.56	-1.80	77.36	77.48	74.92	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	0.50	3.50	2.00	1.50	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	19.80	2.10	17.70	15.20	15.00	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	16.55	0.00	16.55	18.61	17.92	85.87	8.46	192.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	81.5/81.25	SPRD							
03Y	79.5/79.75								
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y	88								
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	75 건	-19	94	103	116	147	100	85	
금 액	16,060 억원	-8,145	24,205	51,818	34,637	38,558	18,471	23,400	

장중동향

국고채 금리, 상승 마감. 장 마감에 가까워지면서 초장기물 금리 상승.

IRS, 금리 상승. 커브 스티프닝.

3Y 구간을 중심으로 호가 대치가 활발했으며, 국채선물 움직임에 비해 비디쉬한 모습을 보이면서 금리 상승.

20년 입찰과 더불어 10선 움직임에 따라 10Y-12Y 구간 장기 수요도 보임.

CRS, 금리 보합 마감.