

IPS Daily Morning Brief

2019-01-25

종가 기준일 2019-01-24

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8575	0.50	1.8545	1.8654	1.8386	1.9125	1.4125	2.2475	1.2875
9M	1.8500	0.50	1.8475	1.8524	1.8438	1.9125	1.4550	2.1975	1.2500
1Y	1.8350	0.50	1.8355	1.8345	1.8428	1.9200	1.5000	2.1825	1.2200
1.5Y	1.8225	0.50	1.8230	1.8134	1.8433	2.0250	1.5550	2.1925	1.1900
2Y	1.7975	0.50	1.8020	1.7853	1.8379	2.1150	1.6000	2.2175	1.1675
3Y	1.7750	0.75	1.7805	1.7594	1.8347	2.2225	1.6750	2.2800	1.1550
4Y	1.7700	0.50	1.7755	1.7548	1.8441	2.2950	1.6900	2.3600	1.1575
5Y	1.7700	0.50	1.7770	1.7534	1.8538	2.3400	1.6825	2.4375	1.1575
7Y	1.7775	0.25	1.7870	1.7636	1.8729	2.3950	1.7000	2.5500	1.1675
10Y	1.8250	0.25	1.8350	1.8108	1.9278	2.4850	1.7525	2.6950	1.2125
12Y	1.8525	0.25	1.8615	1.8348	1.9534	2.5225	1.7750	2.7675	1.2150
15Y	1.8650	0.25	1.8755	1.8504	1.9621	2.5400	1.7950	2.8450	1.2150
20Y	1.8250	0.25	1.8330	1.8074	1.9415	2.5600	1.7500	2.9925	1.2150

6*9M	-0.75	0.00	-0.70	-1.30	0.51	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.50	0.00	-1.20	-1.79	-0.10	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-3.75	0.00	-3.35	-4.93	-0.49	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.25	0.25	-2.15	-2.59	-0.32	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-2.75	0.00	-2.65	-3.05	0.62	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-2.75	0.00	-2.50	-3.19	1.59	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.50	-0.25	-0.50	-0.46	0.95	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	-0.50	-0.25	-0.35	-0.60	1.91	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	0.00	0.00	0.15	-0.14	0.96	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	0.75	-0.25	1.00	1.03	1.92	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.50	-0.25	5.80	5.74	7.40	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.75	0.00	4.80	4.71	5.48	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.65	2.40	2.57	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.05	3.96	3.44	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	0.00	0.00	-0.20	-0.34	1.38	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	0.20	1.814	1.801	1.844	1.935	1.451	2.153	1.237
1.5Y	1.835	0.30	1.834	1.831	1.881	2.113	1.585	2.185	1.232
2Y	1.835	1.10	1.829	1.827	1.882	2.230	1.675	2.230	1.225
3Y	1.812	1.20	1.809	1.804	1.863	2.315	1.737	2.315	1.200
4Y	1.875	1.00	1.877	1.875	1.944	2.502	1.849	2.502	1.232
5Y	1.877	1.00	1.881	1.875	1.950	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.984	0.80	1.990	1.971	2.038	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	1.992	0.60	2.003	1.976	2.076	2.815	1.923	2.862	1.355
20Y	2.037	0.00	2.048	2.001	2.057	2.792	1.910	3.042	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.75	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.26	-0.03	109.30	109.35	109.26
LKTb	127.00	-0.05	127.10	127.23	126.98

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	1.90	0.30	2.15	3.35	-0.14	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-1.25	0.20	-1.12	-1.74	-3.78	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-3.75	-0.60	-2.66	-4.21	-4.44	-0.25	-18.30	0.25	-25.15
3Y	-3.70	-0.45	-2.83	-4.47	-2.84	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.50	-0.50	-10.19	-12.01	-10.02	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.70	-0.50	-10.40	-12.17	-9.61	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-20.65	-0.55	-20.34	-20.71	-16.50	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.70	-0.35	-16.80	-16.51	-14.83	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-21.20	0.25	-21.48	-19.33	-11.50	1.75	-34.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1128.60 (+1.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-46.50	1.50	1Y	1.3700	2.00	1.6200	0.8900	1*2Y	-14.00	-1.00	
-52.25	1.00	1.5Y	1.3000	1.50	1.6600	0.9050	2*3Y	-2.50	0.00	
-56.75	0.50	2Y	1.2300	1.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-3.50	-0.50	
-57.00	0.25	3Y	1.2050	1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-0.50	0.00	
-57.00	0.50	4Y	1.2000	1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-1.00	-0.50	
-57.50	0.00	5Y	1.1950	0.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-0.50	-0.50	
-52.25	0.25	7Y	1.2550	0.50	1.8950	1.0950	5*7Y	6.00	0.00	
-43.50	0.25	10Y	1.3900	0.50	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	2.5438	-0.0391	2.5829	2.5869	2.6201	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7144	-0.0314	2.7458	2.7388	2.7856	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	70.88	-5.01	75.89	76.99	78.81	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	72.24	-3.74	75.98	74.38	75.56	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	2.75	-0.25	3.00	3.25	4.00	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTB 2*10Y	15.70	-0.50	16.20	17.80	19.80	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	17.06	0.77	16.29	15.19	16.55	85.87	8.46	191.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y		SPRD							
03Y	76.5/76.25								
04Y	76/76.5								
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y 23								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	56 건	-60	116	95	75	94	103	116	
금 액	15,005 억원	-18,189	33,194	35,223	16,060	24,205	51,818	34,637	

장중동향
 채권 금리 소폭상승.
 예상했던 금리 동결은 시장에 큰 영향을 미치지 못했고, 아직 금리 인하를 논할 단계가 아니라는 총재의 발언에 채권은 하락. 등락을 거듭함 국채선물은 약보합 마감.

IRS는 국채선물에 연동하며 상승 마감.
 금통위결과 발표와 총재멘트에 따라 움직였지만 거래는 제한적.

CRS는 상승 마감.