

IPS Daily Morning Brief

2019-01-28

종가 기준일 2019-01-25

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8575	0.00	1.8545	1.8643	1.8403	1.9125	1.4125	2.2300	1.2875
9M	1.8500	0.00	1.8475	1.8513	1.8450	1.9125	1.4550	2.1925	1.2500
1Y	1.8350	0.00	1.8350	1.8331	1.8434	1.9200	1.5000	2.1825	1.2200
1.5Y	1.8175	-0.50	1.8220	1.8123	1.8431	2.0250	1.5550	2.1925	1.1900
2Y	1.7950	-0.25	1.7995	1.7848	1.8370	2.1150	1.6000	2.2175	1.1675
3Y	1.7700	-0.50	1.7765	1.7591	1.8328	2.2225	1.6750	2.2800	1.1550
4Y	1.7650	-0.50	1.7720	1.7546	1.8416	2.2950	1.6900	2.3600	1.1575
5Y	1.7650	-0.50	1.7730	1.7534	1.8508	2.3400	1.6825	2.4375	1.1575
7Y	1.7750	-0.25	1.7830	1.7639	1.8695	2.3950	1.7000	2.5500	1.1675
10Y	1.8200	-0.50	1.8305	1.8111	1.9240	2.4850	1.7525	2.6950	1.2125
12Y	1.8475	-0.50	1.8575	1.8355	1.9497	2.5225	1.7750	2.7675	1.2150
15Y	1.8600	-0.50	1.8710	1.8513	1.9586	2.5400	1.7950	2.8450	1.2150
20Y	1.8200	-0.50	1.8295	1.8083	1.9373	2.5600	1.7500	2.9925	1.2150

6*9M	-0.75	0.00	-0.70	-1.30	0.47	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.50	0.00	-1.25	-1.81	-0.15	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-4.00	-0.25	-3.55	-4.84	-0.64	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.50	-0.25	-2.30	-2.56	-0.42	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-3.00	-0.25	-2.75	-3.01	0.46	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-3.00	-0.25	-2.65	-3.14	1.38	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.50	0.00	-0.45	-0.45	0.88	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	-0.50	0.00	-0.35	-0.58	1.80	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	0.00	0.00	0.10	-0.12	0.92	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	1.00	0.25	1.00	1.05	1.88	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.50	0.00	5.75	5.78	7.33	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.50	-0.25	4.75	4.73	5.45	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.70	2.44	2.57	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.05	4.01	3.45	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	0.00	0.00	-0.10	-0.29	1.32	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.819	0.30	1.815	1.800	1.843	1.935	1.451	2.153	1.237
1.5Y	1.840	0.50	1.835	1.830	1.880	2.113	1.585	2.185	1.232
2Y	1.827	-0.80	1.827	1.826	1.880	2.230	1.675	2.230	1.225
3Y	1.810	-0.20	1.808	1.804	1.861	2.315	1.737	2.315	1.200
4Y	1.875	0.00	1.874	1.875	1.942	2.502	1.849	2.502	1.232
5Y	1.880	0.30	1.878	1.876	1.947	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.992	0.80	1.989	1.973	2.035	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	2.002	1.00	2.001	1.979	2.072	2.815	1.923	2.862	1.355
20Y	2.052	1.50	2.050	2.005	2.055	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	109.27	0.01	109.29	109.31	109.24
LKTB	126.90	-0.10	127.09	127.16	126.81

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	1.60	-0.30	1.96	3.29	0.03	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-2.25	-1.00	-1.32	-1.77	-3.66	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-3.20	0.55	-2.75	-4.14	-4.34	-0.25	-18.30	0.25	-25.15
3Y	-4.00	-0.30	-3.13	-4.51	-2.82	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.00	-0.50	-10.24	-12.02	-10.05	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-11.50	-0.80	-10.50	-12.24	-9.63	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.70	-1.05	-20.58	-20.93	-16.57	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-18.20	-1.50	-17.05	-16.79	-14.83	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-23.20	-2.00	-22.07	-19.72	-11.73	1.75	-34.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1121.30 (-7.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-47.50	-1.00	1Y	1.3600	-1.00	1.6200	0.8900	1*2Y	-14.00	0.00		
-52.75	-0.50	1.5Y	1.2900	-1.00	1.6600	0.9050	2*3Y	-2.50	0.00		
-57.50	-0.75	2Y	1.2200	-1.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-4.50	-1.00		
-57.50	-0.50	3Y	1.1950	-1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-1.00	-0.50		
-58.00	-1.00	4Y	1.1850	-1.50	1.8000	1.0700	3*5Y	-2.00	-1.00		
-59.00	-1.50	5Y	1.1750	-2.00	1.8500	1.0400	4*5Y	-1.00	-0.50		
-54.00	-1.75	7Y	1.2350	-2.00	1.8950	1.0950	5*7Y	6.00	0.00		
-45.00	-1.50	10Y	1.3700	-2.00	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	2.6084	0.0646	2.5438	2.5829	2.5869	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7589	0.0445	2.7144	2.7458	2.7388	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	78.14	7.26	70.88	75.89	76.99	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	75.69	3.45	72.24	75.98	74.38	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	2.50	-0.25	2.75	3.00	3.25	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	17.50	1.80	15.70	16.20	17.80	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	15.05	-2.01	17.06	16.29	15.19	85.87	8.46	191.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	79.25 / 78.75							2*5Y -3.25	
03Y									
04Y									
05Y									
07Y									
10Y	79.75								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y CCS 20								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			90 건	34	56	116	95	75	94
금 액			22,319 억원	7,314	15,005	33,194	35,223	16,060	24,205
									51,818

장중동향
국고채 금리, 상승 마감. 초장기물 약세.

IRS, 1.5Y 이상 구간에서 금리 하락. 커브 플랫트닝.
전반적으로 거래량이 많지 않았으며, 외은을 중심으로 오퍼리시한 모습을 보임.

CRS, 전 구간 금리 하락 마감.
2Y과 3Y를 중심으로 수요가 있는 분위기.