

IPS Daily Morning Brief

2019-01-29

종가 기준일 2019-01-28

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8525	-0.50	1.8535	1.8621	1.8419	1.9125	1.4125	2.2275	1.2875
9M	1.8475	-0.25	1.8465	1.8493	1.8460	1.9125	1.4550	2.1925	1.2500
1Y	1.8325	-0.25	1.8325	1.8310	1.8440	1.9200	1.5000	2.1825	1.2200
1.5Y	1.8200	0.25	1.8190	1.8109	1.8429	2.0250	1.5550	2.1925	1.1900
2Y	1.7975	0.25	1.7950	1.7843	1.8358	2.1150	1.6000	2.2175	1.1675
3Y	1.7750	0.50	1.7710	1.7590	1.8306	2.2225	1.6750	2.2800	1.1550
4Y	1.7700	0.50	1.7670	1.7546	1.8388	2.2950	1.6900	2.3600	1.1575
5Y	1.7750	1.00	1.7685	1.7539	1.8475	2.3400	1.6825	2.4375	1.1575
7Y	1.7850	1.00	1.7780	1.7645	1.8658	2.3950	1.7000	2.5475	1.1675
10Y	1.8350	1.50	1.8255	1.8121	1.9201	2.4850	1.7525	2.6875	1.2125
12Y	1.8625	1.50	1.8530	1.8368	1.9458	2.5225	1.7750	2.7625	1.2150
15Y	1.8750	1.50	1.8660	1.8526	1.9548	2.5400	1.7950	2.8375	1.2150
20Y	1.8375	1.75	1.8260	1.8099	1.9328	2.5600	1.7500	2.9925	1.2150

6*9M	-0.50	0.25	-0.70	-1.29	0.42	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.50	0.00	-1.40	-1.83	-0.21	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-3.50	0.50	-3.75	-4.68	-0.82	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.25	0.25	-2.40	-2.53	-0.52	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-2.75	0.25	-2.80	-2.96	0.30	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-2.25	0.25	-2.65	-3.04	1.18	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.50	0.00	-0.40	-0.44	0.82	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	0.00	0.50	-0.25	-0.51	1.69	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	0.50	0.50	0.15	-0.07	0.88	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	1.00	0.00	0.95	1.06	1.83	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	6.00	0.50	5.70	5.83	7.25	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	5.00	0.50	4.75	4.76	5.43	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.46	2.57	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.05	4.05	3.47	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	0.25	0.25	0.05	-0.23	1.27	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.825	0.60	1.817	1.800	1.842	1.935	1.451	2.153	1.237
1.5Y	1.845	0.50	1.837	1.829	1.878	2.113	1.585	2.185	1.232
2Y	1.835	0.80	1.828	1.825	1.879	2.230	1.675	2.230	1.225
3Y	1.817	0.70	1.807	1.805	1.859	2.315	1.737	2.315	1.200
4Y	1.884	0.90	1.873	1.875	1.940	2.502	1.849	2.502	1.232
5Y	1.890	1.00	1.877	1.877	1.944	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	2.004	1.20	1.987	1.976	2.032	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	2.015	1.30	1.998	1.983	2.069	2.815	1.923	2.847	1.355
20Y	2.085	3.30	2.052	2.012	2.053	2.792	1.910	3.027	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.78	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.25	-0.02	109.27	109.27	109.23
LKTB	126.74	-0.16	126.82	126.86	126.67

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	0.75	-0.85	1.53	3.13	0.19	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-2.50	-0.25	-1.76	-1.84	-3.56	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-3.75	-0.55	-3.26	-4.10	-4.29	-0.25	-18.30	0.25	-25.15
3Y	-4.20	-0.20	-3.62	-4.56	-2.83	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.40	-0.40	-10.58	-12.05	-10.08	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-11.50	0.00	-10.81	-12.26	-9.65	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.90	-0.20	-20.94	-21.16	-16.66	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-18.00	0.20	-17.25	-17.08	-14.84	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-24.75	-1.55	-22.62	-20.22	-12.00	1.75	-34.50	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1117.70 (-3.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-45.75	1.75	1Y	1.3750	1.50	1.6200	0.8900	1*2Y	-14.50	-0.50	
-52.00	0.75	1.5Y	1.3000	1.00	1.6600	0.9050	2*3Y	-2.50	0.00	
-56.75	0.75	2Y	1.2300	1.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-4.50	0.00	
-57.00	0.50	3Y	1.2050	1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-1.00	0.00	
-57.50	0.50	4Y	1.1950	1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-2.00	0.00	
-59.00	0.00	5Y	1.1850	1.00	1.8500	1.0400	4*5Y	-1.00	0.00	
-52.50	1.50	7Y	1.2600	2.50	1.8950	1.0950	5*7Y	7.50	1.50	
-44.00	1.00	10Y	1.3950	2.50	2.0500	1.2600	5*10Y	21.00	1.50	

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	2.6044	-0.0040	2.6084	2.5438	2.5829	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7472	-0.0117	2.7589	2.7144	2.7458	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	76.94	-1.2	78.14	70.88	75.89	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	73.22	-2.47	75.69	72.24	75.98	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	3.75	1.25	2.50	2.75	3.00	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	18.00	0.50	17.50	15.70	16.20	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	14.28	-0.77	15.05	17.06	16.29	85.87	8.46	191.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	83.25								
1.5Y	81.75								
02Y		SPRD	1*2y -3.5						
03Y	77.75								
04Y									
05Y	77.5								
07Y									
10Y	83/83.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	58 건	-32	90	56	116	95	75	94	
금 액	18,708 억원	-3,611	22,319	15,005	33,194	35,223	16,060	24,205	

장중동향

국고채 금리 상승.

상대적으로 장기물의 약세가 커 커브 스톱.

IRS는 단기를 제외한 전 구간 상승. 커브 스티프닝.

중단기쪽으로 오퍼가 많았고 1년이하 단기가 현물대비 유난히 강세.

CRS도 전 구간 상승 마감.