

IPS Daily Morning Brief

2019-01-30

종가 기준일 2019-01-29

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8550	0.25	1.8550	1.8593	1.8435	1.9125	1.4125	2.2200	1.2875
9M	1.8500	0.25	1.8485	1.8470	1.8472	1.9125	1.4550	2.1925	1.2500
1Y	1.8350	0.25	1.8335	1.8290	1.8445	1.9200	1.5000	2.1825	1.2200
1.5Y	1.8250	0.50	1.8205	1.8095	1.8427	2.0250	1.5550	2.1900	1.1900
2Y	1.8025	0.50	1.7970	1.7835	1.8346	2.1150	1.6000	2.2075	1.1675
3Y	1.7825	0.75	1.7740	1.7589	1.8285	2.2225	1.6750	2.2675	1.1550
4Y	1.7775	0.75	1.7695	1.7546	1.8360	2.2950	1.6900	2.3450	1.1575
5Y	1.7800	0.50	1.7710	1.7543	1.8443	2.3400	1.6825	2.4150	1.1575
7Y	1.7900	0.50	1.7805	1.7648	1.8621	2.3950	1.7000	2.5300	1.1675
10Y	1.8400	0.50	1.8285	1.8126	1.9162	2.4850	1.7525	2.6725	1.2125
12Y	1.8675	0.50	1.8560	1.8376	1.9418	2.5225	1.7750	2.7425	1.2150
15Y	1.8800	0.50	1.8685	1.8535	1.9510	2.5400	1.7950	2.8125	1.2150
20Y	1.8450	0.75	1.8300	1.8110	1.9283	2.5600	1.7500	2.9725	1.2150

6*9M	-0.50	0.00	-0.65	-1.23	0.37	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.50	0.00	-1.50	-1.80	-0.26	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-3.25	0.25	-3.65	-4.55	-0.99	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.00	0.25	-2.30	-2.46	-0.61	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-2.50	0.25	-2.75	-2.89	0.14	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-2.25	0.00	-2.60	-2.93	0.97	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.50	0.00	-0.45	-0.43	0.75	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	-0.25	-0.25	-0.30	-0.46	1.58	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	0.25	-0.25	0.15	-0.04	0.83	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	1.00	0.00	0.95	1.05	1.78	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	6.00	0.00	5.75	5.84	7.19	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	5.00	0.00	4.80	4.79	5.40	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.50	2.57	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.00	4.09	3.49	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	0.50	0.25	0.15	-0.16	1.22	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.829	0.40	1.821	1.799	1.841	1.935	1.452	2.150	1.237
1.5Y	1.845	0.00	1.839	1.828	1.877	2.113	1.585	2.185	1.232
2Y	1.837	0.20	1.832	1.824	1.877	2.230	1.675	2.230	1.225
3Y	1.820	0.30	1.812	1.804	1.857	2.315	1.737	2.315	1.200
4Y	1.895	1.10	1.879	1.875	1.937	2.502	1.849	2.502	1.232
5Y	1.900	1.00	1.883	1.877	1.941	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	2.019	1.50	1.995	1.979	2.030	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	2.037	2.20	2.006	1.987	2.065	2.815	1.923	2.840	1.355
20Y	2.095	1.00	2.061	2.018	2.051	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.73	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.21	-0.04	109.26	109.27	109.21
LKTb	126.48	-0.26	126.72	126.81	126.48

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	0.60	-0.15	1.29	2.96	0.33	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-2.00	0.50	-1.89	-1.89	-3.46	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-3.45	0.30	-3.46	-4.09	-4.25	-0.25	-18.30	0.25	-25.15
3Y	-3.75	0.45	-3.78	-4.55	-2.84	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.75	-0.35	-10.93	-12.08	-10.12	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.00	-0.50	-11.18	-12.27	-9.67	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.90	-1.00	-21.45	-21.41	-16.77	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.70	-1.70	-17.79	-17.44	-14.88	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-25.00	-0.25	-23.12	-20.70	-12.28	1.75	-33.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1116.50 (-1.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-44.50	1.25	1Y	1.3900	1.50	1.6200	0.8900	1*2Y	-14.50	0.00	
-51.00	1.00	1.5Y	1.3150	1.50	1.6600	0.9050	2*3Y	-3.00	-0.50	
-55.75	1.00	2Y	1.2450	1.50	1.6950	0.9200	2*5Y	-5.50	-1.00	
-56.75	0.25	3Y	1.2150	1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-1.50	-0.50	
-57.75	-0.25	4Y	1.2000	0.50	1.8000	1.0700	3*5Y	-2.50	-0.50	
-59.00	0.00	5Y	1.1900	0.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-1.00	0.00	
-52.50	0.00	7Y	1.2650	0.50	1.8950	1.0950	5*7Y	7.50	0.00	
-44.00	0.00	10Y	1.4000	0.50	2.0500	1.2600	5*10Y	21.00	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	2.5765	-0.0279	2.6044	2.6084	2.5438	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7121	-0.0351	2.7472	2.7589	2.7144	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	73.95	-2.99	76.94	78.14	70.88	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	67.51	-5.71	73.22	75.69	72.24	98.82	-24.13	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	0.00	3.75	2.50	2.75	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	20.00	2.00	18.00	17.50	15.70	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	13.56	-0.72	14.28	15.05	17.06	85.87	8.46	191.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
	06M									
	09M	85								
	01Y	83.25 / 83.5								
	1.5Y				SPRD					
	02Y	79.5/79.75				18m*3y -4.5				
	03Y	78				2y*4y -2.5				
	04Y					2y*5y -2.25				
	05Y	77/77.25								
	07Y									
	10Y	83.25/83								
	12Y									
	15Y									
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6		
거래현황	84 건	26	58	90	56	116	95	75		
금 액	29,609 억원	10,901	18,708	22,319	15,005	33,194	35,223	16,060		

장중동향
국고채 금리, 4거래일 연속 금리 상승.
30년물 입찰은 다소 약했다는 평가. 다만 초장기물의 금리 상승폭은 소폭.

IRS, 3-4Y 구간을 중심으로 금리 소폭 상승. 방향성 없는 장세.
거래가 활발하지는 않았으나, 호가가 국채선물 움직임에 연동되어 비디쉬했던 분위기.

CRS, 금리 상승 마감. 커브 플랫트닝.