

IPS Daily Morning Brief

2019-01-31

종가 기준일 2019-01-30

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8575	0.25	1.8560	1.8569	1.8448	1.9125	1.4125	2.2200	1.2875
9M	1.8550	0.50	1.8505	1.8455	1.8479	1.9125	1.4550	2.1925	1.2500
1Y	1.8400	0.50	1.8355	1.8279	1.8446	1.9200	1.5000	2.1825	1.2200
1.5Y	1.8300	0.50	1.8230	1.8091	1.8419	2.0250	1.5550	2.1900	1.1900
2Y	1.8075	0.50	1.8000	1.7840	1.8329	2.1150	1.6000	2.2075	1.1675
3Y	1.7875	0.50	1.7780	1.7600	1.8257	2.2225	1.6750	2.2675	1.1550
4Y	1.7825	0.50	1.7730	1.7556	1.8326	2.2950	1.6900	2.3450	1.1575
5Y	1.7875	0.75	1.7755	1.7556	1.8405	2.3400	1.6825	2.4150	1.1575
7Y	1.8000	1.00	1.7855	1.7660	1.8580	2.3950	1.7000	2.5300	1.1675
10Y	1.8525	1.25	1.8345	1.8139	1.9118	2.4850	1.7525	2.6725	1.2125
12Y	1.8800	1.25	1.8620	1.8393	1.9375	2.5225	1.7750	2.7425	1.2150
15Y	1.8925	1.25	1.8745	1.8548	1.9469	2.5400	1.7950	2.8125	1.2150
20Y	1.8625	1.75	1.8380	1.8128	1.9236	2.5600	1.7500	2.9725	1.2150

6*9M	-0.25	0.25	-0.55	-1.14	0.31	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.50	0.00	-1.50	-1.76	-0.33	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-3.25	0.00	-3.55	-4.39	-1.17	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-2.00	0.00	-2.20	-2.40	-0.72	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-2.50	0.00	-2.70	-2.84	-0.03	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-2.00	0.25	-2.45	-2.84	0.76	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.50	0.00	-0.50	-0.44	0.69	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	0.00	0.25	-0.25	-0.44	1.48	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	0.50	0.25	0.25	0.00	0.79	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	1.25	0.25	1.00	1.04	1.75	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	6.50	0.50	5.90	5.83	7.13	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	5.25	0.25	4.90	4.79	5.38	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.54	2.57	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	0.00	4.00	4.09	3.50	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	1.00	0.50	0.35	-0.11	1.18	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.832	0.30	1.824	1.801	1.840	1.935	1.463	2.145	1.237
1.5Y	1.851	0.60	1.843	1.829	1.876	2.113	1.595	2.185	1.232
2Y	1.841	0.40	1.835	1.825	1.875	2.230	1.675	2.230	1.225
3Y	1.830	1.00	1.818	1.806	1.854	2.315	1.737	2.315	1.200
4Y	1.905	1.00	1.887	1.877	1.934	2.502	1.849	2.502	1.232
5Y	1.910	1.00	1.891	1.879	1.938	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	2.028	0.90	2.005	1.982	2.027	2.728	1.913	2.728	1.270
10Y	2.047	1.00	2.019	1.992	2.061	2.815	1.923	2.840	1.355
20Y	2.098	0.30	2.073	2.024	2.049	2.792	1.910	3.015	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.74	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.16	-0.05	109.24	109.25	109.15
LKTB	126.35	-0.13	126.64	126.66	126.28

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	0.80	0.20	1.13	2.66	0.43	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-2.10	-0.10	-2.02	-2.00	-3.41	0.40	-15.60	2.40	-19.10
2Y	-3.35	0.10	-3.50	-4.09	-4.21	-0.25	-18.30	0.25	-25.15
3Y	-4.25	-0.50	-3.98	-4.61	-2.87	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-12.25	-0.50	-11.38	-12.15	-10.17	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.25	-0.25	-11.59	-12.30	-9.71	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.80	0.10	-21.99	-21.65	-16.87	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.45	0.25	-18.41	-17.80	-14.92	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-23.55	1.45	-23.54	-21.13	-12.54	1.75	-33.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1116.30 (-0.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-45.50	-1.00	1Y	1.3850	-0.50	1.6200	0.8900	1*2Y	-14.00	0.50		
-52.00	-1.00	1.5Y	1.3100	-0.50	1.6600	0.9050	2*3Y	-3.00	0.00		
-56.25	-0.50	2Y	1.2450	0.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-6.00	-0.50		
-57.25	-0.50	3Y	1.2150	0.00	1.7550	0.9850	3*4Y	-2.00	-0.50		
-58.75	-1.00	4Y	1.1950	-0.50	1.8000	1.0700	3*5Y	-3.00	-0.50		
-60.25	-1.25	5Y	1.1850	-0.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-1.00	0.00		
-53.50	-1.00	7Y	1.2650	0.00	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.50		
-45.25	-1.25	10Y	1.4000	0.00	2.0500	1.2600	5*10Y	21.50	0.50		

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	2.5161	-0.0604	2.5765	2.6044	2.6084	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.6815	-0.0306	2.7121	2.7472	2.7589	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	67.51	-6.44	73.95	76.94	78.14	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	63.45	-4.06	67.51	73.22	75.69	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	4.50	0.75	3.75	3.75	2.50	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTB 2*10Y	20.60	0.60	20.00	18.00	17.50	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	16.54	2.98	13.56	14.28	15.05	85.87	8.46	191.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M	85.75								
09M									
01Y	84								
1.5Y									
02Y		SPRD	2*3y -2						
03Y			10*20y 0.75						
04Y									
05Y	78/78.5								
07Y									
10Y	83/84								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y*3y -3								
	3y 21.5								
	2y 24.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	94 건	10	84	58	90	56	116	95	
금 액	25,058 억원	-4,551	29,609	18,708	22,319	15,005	33,194	35,223	

장중동향

국고채 금리, 코스피 2200선 회복 영향에 상승 마감.

IRS, 전 구간 금리 소폭 상승.

장 초반 5Y 위주의 외인의 강한 오포로 본드스왑이 확대 되었으나, FOMC 경계감에 헤지수요가 나오며 되돌림.

CRS, 일부 구간 금리 소폭 하락 마감.