IPS Daily Morning Brief

2019-01-14

종가 기준일 2019-01-11

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8600	0.25	1.8575	1.8845	1.8285	1.9125	1.4125	2.2825	1.2875
9M	1.8475	0.50	1.8410	1.8690	1.8401	1.9125	1.4550	2.2625	1.2500
1Y	1.8300	0.75	1.8200	1.8499	1.8461	1.9200	1.5000	2.2425	1.2200
1.5Y	1.8100	0.75	1.7985	1.8303	1.8551	2.0250	1.5550	2.2550	1.1900
2Y	1.7850	1.00	1.7710	1.8021	1.8579	2.1150	1.6000	2.2800	1.1675
3Y	1.7700	1.75	1.7510	1.7726	1.8639	2.2225	1.6750	2.3600	1.1550
4Y	1.7775	2.75	1.7485	1.7686	1.8791	2.2950	1.6900	2.4475	1.1575
5Y	1.7825	3.25	1.7485	1.7670	1.8934	2.3400	1.6825	2.5200	1.1575
7Y	1.7925	3.75	1.7595	1.7780	1.9168	2.3950	1.7000	2.6350	1.1675
10Y	1.8400	4.50	1.8070	1.8271	1.9743	2.4850	1.7525	2.7775	1.2125
12Y	1.8650	4.50	1.8310	1.8491	2.0003	2.5225	1.7750	2.8350	1.2150
15Y	1.8825	4.50	1.8490	1.8614	2.0071	2.5400	1.7950	2.8950	1.2150
20Y	1.8375	4.50	1.8040	1.8239	1.9936	2.5600	1.7500	3.0325	1.2150

6*9M	-1.25	0.25	-1.65	-1.55	1.16	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.75	0.25	-2.10	-1.91	0.60	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-4.50	0.25	-4.90	-4.78	1.18	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-1.50	0.75	-2.00	-2.95	0.60	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-0.75	1.75	-2.25	-3.35	2.13	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-0.25	2.25	-2.25	-3.51	3.55	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	0.75	1.00	-0.25	-0.40	1.52	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	1.25	1.50	-0.25	-0.56	2.95	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	0.50	0.50	0.00	-0.16	1.43	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	1.00	0.50	1.10	1.10	2.33	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.75	1.25	5.85	6.01	8.08	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.75	0.75	4.75	4.91	5.75	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.00	2.40	2.20	2.61	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.00	4.20	3.43	3.29	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	-0.25	0.00	-0.30	-0.33	1.94	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.792	1.50	1.777	1.808	1.856	1.935	1.451	2.220	1.237
1.5Y	1.825	1.00	1.816	1.845	1.897	2.113	1.585	2.255	1.232
2Y	1.827	1.10	1.819	1.835	1.904	2.230	1.675	2.295	1.225
3Y	1.802	1.00	1.803	1.803	1.889	2.315	1.737	2.352	1.200
4Y	1.877	1.70	1.879	1.882	1.975	2.502	1.849	2.532	1.232
5Y	1.875	2.00	1.879	1.878	1.986	2.602	1.825	2.605	1.217
7Y	1.983	2.90	1.975	1.963	2.074	2.728	1.913	2.802	1.270
10Y	1.995	3.50	1.981	1.972	2.121	2.815	1.923	2.987	1.355
20Y	2.005	2.50	1.988	1.970	2.087	2.792	1.910	3.147	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.26	-0.04	109.29	109.32	109.25
LKTB	126.90	-0.27	127.05	127.13	126.88

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	3.80	-0.75	4.30	4.21	-1.02	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-1.50	-0.25	-1.75	-1.49	-4.22	0.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-4.20	-0.10	-4.78	-3.26	-4.66	-0.25	-18.30	1.80	-25.15
3Y	-3.20	0.75	-5.24	-3.07	-2.54	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-9.95	1.05	-13.07	-11.35	-9.57	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.25	1.25	-13.01	-11.11	-9.27	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-19.05	0.85	-21.59	-18.49	-15.68	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-15.50	1.00	-17.42	-14.47	-14.65	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-16.75	2.00	-18.40	-14.60	-9.32	1.75	-34.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-50.00	-2.75
-55.00	-1.75
-59.00	-0.50
-60.50	-1.25
-60.75	-1.75
-60.25	-1.25
-53.25	-1.75
-44.00	-2.50

CRS

USD/KRW 1116.40 (-1.90)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.3300	-2.00	1.6200	0.8900	1*2Y	-13.50	2.50
1.5Y	1.2600	-1.00	1.6600	0.9050	2*3Y	-3.00	0.00
2Y	1.1950	0.50	1.6950	0.9200	2*5Y	-1.50	1.50
3Y	1.1650	0.50	1.7550	0.9850	3*4Y	0.50	0.50
4Y	1.1700	1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	1.50	1.50
5Y	1.1800	2.00	1.8500	1.0400	4*5Y	1.00	1.00
7Y	1.2600	2.00	1.8950	1.0950	5*7Y	8.00	0.00
10Y	1.4000	2.00	2.0500	1.2600	5*10Y	22.00	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	2.5490	-0.0285	2.5775	2.5611	2.5896	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7021	-0.0450	2.7471	2.7115	2.7321	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	72.20	-3.95	76.15	74.01	76.96	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	70.71	-8.00	78.71	73.25	74.01	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	5.50	3.50	2.00	3.50	4.00	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTB 2*10Y	16.80	2.40	14.40	15.80	17.20	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	15.31	-1.65	16.96	15.04	14.25	88.01	8.46	201.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y		SPRD	2y*3y -1.5
03Y			2y*5y -1
04Y			2y*10y 4.25
05Y	77		5y*9y 2.75
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	85 건	0	85	137	98	113	168	137
금 액	23,400 억원	655	22,745	43,641	22,502	30,760	45,880	36,889

장중동향

국고채 금리, 조정 장세를 보이며 금리 상승 마감.

IRS, 위험자산 선호 분위기에 금리 상승하며 커브 스티프닝.
외국계 기관을 중심으로 장기 구간이 비디쉬했던 모습.

CRS, 2Y 이상 구간에서 금리 상승.