IPS Daily Morning Brief

2019-01-04

종가 기준일 2019-01-03

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8950	-1.00	1.8975	1.8951	1.8208	1.9125	1.4125	2.2825	1.2875
9M	1.8750	-1.00	1.8830	1.8831	1.8400	1.9125	1.4550	2.2625	1.2500
1Y	1.8500	-1.25	1.8650	1.8700	1.8526	1.9200	1.5000	2.2625	1.2200
1.5Y	1.8250	-1.25	1.8405	1.8555	1.8704	2.0250	1.5550	2.2925	1.1900
2Y	1.7850	-1.25	1.8025	1.8313	1.8805	2.1150	1.6000	2.3275	1.1675
3Y	1.7450	-2.00	1.7695	1.8026	1.8937	2.2225	1.6750	2.4175	1.1550
4Y	1.7425	-2.00	1.7640	1.7986	1.9137	2.2950	1.7250	2.5150	1.1575
5Y	1.7350	-2.50	1.7595	1.7984	1.9315	2.3400	1.7350	2.5950	1.1575
7Y	1.7475	-2.75	1.7700	1.8081	1.9570	2.3950	1.7475	2.7050	1.1675
10Y	1.8000	-2.75	1.8170	1.8573	2.0162	2.4850	1.7950	2.8450	1.2125
12Y	1.8225	-2.50	1.8380	1.8786	2.0434	2.5225	1.8175	2.8975	1.2150
15Y	1.8425	-2.50	1.8525	1.8861	2.0490	2.5400	1.8250	2.9500	1.2150
20Y	1.8000	-2.75	1.8115	1.8585	2.0400	2.5600	1.7875	3.0700	1.2150

6*9M	-2.00	0.00	-1.45	-1.20	1.93	12.50	-2.00	12.50	-6.00
9*12M	-2.50	-0.25	-1.80	-1.31	1.25	10.50	-2.50	10.50	-4.25
1*2Y	-6.50	0.00	-6.25	-3.88	2.79	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-4.00	-0.75	-3.30	-2.86	1.33	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.25	-0.75	-3.85	-3.26	3.32	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-5.00	-1.25	-4.30	-3.29	5.10	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	-0.25	0.00	-0.55	-0.40	2.00	8.50	-0.75	11.25	-0.75
3*5Y	-1.00	-0.50	-1.00	-0.42	3.78	14.00	-1.25	22.00	-1.25
4*5Y	-0.75	-0.50	-0.45	-0.02	1.78	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	1.25	-0.25	1.05	0.97	2.55	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	6.50	-0.25	5.75	5.89	8.47	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	5.25	0.00	4.70	4.91	5.92	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.25	0.25	2.10	2.14	2.72	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.25	0.25	3.55	2.89	3.28	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	0.00	0.00	-0.55	0.13	2.38	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.783	-1.20	1.817	1.834	1.868	1.935	1.451	2.280	1.237
1.5Y	1.822	-1.40	1.847	1.869	1.915	2.113	1.585	2.310	1.232
2Y	1.821	-1.00	1.842	1.854	1.925	2.230	1.675	2.347	1.225
3Y	1.802	0.50	1.808	1.816	1.914	2.315	1.737	2.405	1.200
4Y	1.875	0.50	1.878	1.892	2.005	2.502	1.849	2.595	1.232
5Y	1.878	0.30	1.877	1.886	2.022	2.602	1.825	2.676	1.217
7Y	1.964	0.90	1.955	1.961	2.109	2.728	1.913	2.865	1.270
10Y	1.962	1.20	1.948	1.981	2.162	2.815	1.923	3.062	1.355
20Y	1.985	0.90	1.969	1.967	2.121	2.792	1.910	3.240	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.92	-1.00
CALL	1.83	-6.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.26	-0.03	109.35	109.39	109.26
LKTB	127.30	-0.15	127.74	127.78	127.30

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	6.70	-0.05	4.84	3.59	-1.58	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	0.30	0.15	-0.69	-1.32	-4.46	0.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-3.60	-0.25	-3.93	-2.23	-4.45	-0.25	-18.30	1.80	-25.15
3Y	-5.70	-2.50	-3.83	-1.32	-2.05	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-13.25	-2.50	-11.36	-9.32	-9.12	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-14.30	-2.80	-11.77	-8.78	-9.01	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.65	-3.65	-18.46	-15.29	-15.20	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.20	-3.95	-13.14	-12.42	-14.62	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-18.50	-3.65	-15.79	-10.84	-8.10	1.75	-34.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-64.00	-0.25
-66.00	-0.75
-66.00	-1.25
-62.00	-0.50
-64.25	0.00
-65.50	1.00
-55.25	1.25
-42.50	1.25

CRS

USD/KRW 1127.70 (+8.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	1.2100	-1.50	1.6200	0.8800	1*2Y	-8.50	-1.00
1.5Y	1.1650	-2.00	1.6600	0.9050	2*3Y	0.00	0.00
2Y	1.1250	-2.50	1.6950	0.9200	2*5Y	-4.50	1.00
3Y	1.1250	-2.50	1.7550	0.9850	3*4Y	-2.50	0.50
4Y	1.1000	-2.00	1.8000	1.0700	3*5Y	-4.50	1.00
5Y	1.0800	-1.50	1.8500	1.0400	4*5Y	-2.00	0.50
7Y	1.1950	-1.50	1.8950	1.0950	5*7Y	11.50	0.00
10Y	1.3750	-1.50	2.0500	1.2600	5*10Y	29.50	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	2.3866	-0.0972	2.4838	2.5322	2.5724	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.5549	-0.0649	2.6198	2.7185	2.7714	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	56.56	-8.72	65.28	67.82	72.04	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	59.29	-7.69	66.98	76.25	83.44	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	1.50	-1.50	3.00	1.25	0.75	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTB 2*10Y	14.10	2.20	11.90	10.20	8.50	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	16.83	3.23	13.60	18.63	19.90	92.41	8.46	205.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	85 / 84.75		
1.5Y	82 / 81.75		
02Y	77.75 / 78.5	SPRD	9M*2Y -9.5
03Y	74.5 / 74 / 75		
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	80 / 80.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	137 건	74	63	90	57	51	38	86
금 액	36,889 억원	16,777	20,112	36,745	14,805	24,783	11,750	27,885

장중동향

국고채 금리, 글로벌 금융시장 불안으로 안전자산 선호 분위기 이어지는 가운데 보합권 혼조세 마감.
30년물 입찰은 많은 물량에도 무리 없이 시장에서 소화됐다는 평.
(1.960%에 1조8천억 원 규모 발행)

IRS, 전 구간 금리 하락.
3-5Y 구간을 중심으로 역외 오퍼가 강했던 모습.

CRS 금리도 하락 마감.