

IPS Daily Morning Brief

2019-01-15

종가 기준일 2019-01-14

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8500	-1.00	1.8570	1.8821	1.8295	1.9125	1.4125	2.2825	1.2875
9M	1.8375	-1.00	1.8420	1.8668	1.8401	1.9125	1.4550	2.2625	1.2500
1Y	1.8200	-1.00	1.8225	1.8476	1.8451	1.9200	1.5000	2.2425	1.2200
1.5Y	1.7950	-1.50	1.8010	1.8273	1.8530	2.0250	1.5550	2.2550	1.1900
2Y	1.7700	-1.50	1.7750	1.7986	1.8548	2.1150	1.6000	2.2800	1.1675
3Y	1.7400	-3.00	1.7535	1.7689	1.8597	2.2225	1.6750	2.3550	1.1550
4Y	1.7425	-3.50	1.7535	1.7651	1.8743	2.2950	1.6900	2.4400	1.1575
5Y	1.7425	-4.00	1.7545	1.7631	1.8881	2.3400	1.6825	2.5125	1.1575
7Y	1.7500	-4.25	1.7640	1.7736	1.9110	2.3950	1.7000	2.6275	1.1675
10Y	1.7975	-4.25	1.8105	1.8223	1.9683	2.4850	1.7525	2.7700	1.2125
12Y	1.8225	-4.25	1.8350	1.8445	1.9943	2.5225	1.7750	2.8325	1.2150
15Y	1.8375	-4.50	1.8520	1.8573	2.0012	2.5400	1.7950	2.8950	1.2150
20Y	1.7950	-4.25	1.8075	1.8184	1.9870	2.5600	1.7500	3.0325	1.2150

6*9M	-1.25	0.00	-1.50	-1.54	1.05	12.50	-2.25	12.50	-6.00
9*12M	-1.75	0.00	-1.95	-1.91	0.50	10.50	-3.00	10.50	-4.25
1*2Y	-5.00	-0.50	-4.75	-4.90	0.97	23.00	-6.75	23.00	-6.75
2*3Y	-3.00	-1.50	-2.15	-2.98	0.49	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-2.75	-2.00	-2.15	-3.35	1.95	21.75	-4.75	23.50	-4.75
2*5Y	-2.75	-2.50	-2.05	-3.55	3.33	27.25	-5.50	34.00	-5.50
3*4Y	0.25	-0.50	0.00	-0.38	1.46	8.50	-1.00	11.25	-1.00
3*5Y	0.25	-1.00	0.10	-0.58	2.84	14.00	-1.50	22.00	-1.50
4*5Y	0.00	-0.50	0.10	-0.20	1.38	6.00	-0.75	10.75	-0.75
5*7Y	0.75	-0.25	0.95	1.05	2.29	7.25	0.00	14.75	0.00
5*10Y	5.50	-0.25	5.60	5.91	8.02	16.25	4.00	30.75	3.75
7*10Y	4.75	0.00	4.65	4.86	5.73	9.50	4.00	16.75	3.00
10*12Y	2.50	0.00	2.45	2.23	2.60	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	4.00	-0.25	4.15	3.50	3.29	6.75	2.00	15.00	-0.75
10*20Y	-0.25	0.00	-0.30	-0.39	1.87	10.25	-1.50	31.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.802	1.00	1.783	1.806	1.855	1.935	1.451	2.220	1.237
1.5Y	1.825	0.00	1.819	1.843	1.895	2.113	1.585	2.255	1.232
2Y	1.825	-0.20	1.822	1.834	1.902	2.230	1.675	2.295	1.225
3Y	1.797	-0.50	1.801	1.803	1.886	2.315	1.737	2.347	1.200
4Y	1.862	-1.50	1.876	1.880	1.971	2.502	1.849	2.520	1.232
5Y	1.855	-2.00	1.874	1.876	1.981	2.602	1.825	2.602	1.217
7Y	1.959	-2.40	1.972	1.962	2.068	2.728	1.913	2.790	1.270
10Y	1.972	-2.30	1.980	1.970	2.115	2.815	1.923	2.974	1.355
20Y	2.000	-0.50	1.993	1.971	2.083	2.792	1.910	3.137	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.86	0.00
CALL	1.75	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.31	0.05	109.27	109.31	109.22
LKTB	127.25	0.35	126.99	127.28	126.80

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	1.80	-2.00	3.91	4.16	-0.94	6.75	-11.20	9.00	-17.75
1.5Y	-3.00	-1.50	-1.80	-1.58	-4.18	0.40	-15.60	3.75	-19.10
2Y	-5.50	-1.30	-4.68	-3.51	-4.67	-0.25	-18.30	1.80	-25.15
3Y	-5.70	-2.50	-4.79	-3.45	-2.61	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.95	-2.00	-12.27	-11.51	-9.62	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-11.25	-2.00	-11.91	-11.24	-9.28	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-20.90	-1.85	-20.84	-18.85	-15.74	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-17.45	-1.95	-16.91	-14.78	-14.65	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-20.50	-3.75	-18.55	-15.25	-9.57	1.75	-34.95	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1123.00 (+6.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-51.50	-1.50	1Y	1.3050	-2.50	1.6200	0.8900	1*2Y	-13.00	0.50	
-55.50	-0.50	1.5Y	1.2400	-2.00	1.6600	0.9050	2*3Y	-2.00	1.00	
-59.50	-0.50	2Y	1.1750	-2.00	1.6950	0.9200	2*5Y	-0.50	1.00	
-58.50	2.00	3Y	1.1550	-1.00	1.7550	0.9850	3*4Y	0.50	0.00	
-58.25	2.50	4Y	1.1600	-1.00	1.8000	1.0700	3*5Y	1.50	0.00	
-57.25	3.00	5Y	1.1700	-1.00	1.8500	1.0400	4*5Y	1.00	0.00	
-50.50	2.75	7Y	1.2450	-1.50	1.8950	1.0950	5*7Y	7.50	-0.50	
-41.25	2.75	10Y	1.3850	-1.50	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	2.5367	-0.0123	2.5490	2.5775	2.5611	2.9773	1.2620	2.9773	0.3100
10Y	2.7038	0.0017	2.7021	2.7471	2.7115	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	71.17	-1.03	72.20	76.15	74.01	103.03	-53.43	103.03	-187.00
10Y	73.18	2.47	70.71	78.71	73.25	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	2.75	-2.75	5.50	2.00	3.50	42.50	-0.25	62.75	-0.25
KTb 2*10Y	14.70	-2.10	16.80	14.40	15.80	63.50	8.50	82.90	8.50
UST 2*10Y	16.71	1.40	15.31	16.96	15.04	88.01	8.46	201.00	8.46

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6y 76.25						
06M			9y 77.5 / 81						
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	77 / 77.75	SPRD	2*5y 1.75						
03Y	74.25/74.5/74.75		2*10y 03						
04Y	74.75 / 75 / 75.25 / 77		4*10y 5.5						
05Y			5*10y 5.5						
07Y			8*12y 06						
10Y	79.75 / 80 / 81.75 / 82 / 84		9*10y 03						
12Y	83		10/12y 2.5						
15Y			10/15y 04 / 4.25						
20Y	80.5								
CRS	1*5y -14.5 / 2*3y -2								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	100 건	15	85	85	137	98	113	168	
금 액	18,471 억원	-4,929	23,400	22,745	43,641	22,502	30,760	45,880	

장중동향

국고채 금리 하락.

10년물 입찰을 전후로 국채선물은 강세로 전환했고, 외국인의 매수와 증시약세로 강세 마감.

IRS도 선물에 연동하여 레벨 하락.

아웃라잇 오퍼가 우세해 비드가 나오면 기본되는 양상. 10년과 10년 관련 스프레드 거래가 많은 분위기.

CRS도 전 구간 하락 마감.