IPS Daily Morning Brief

2019-07-01

종가 기준일 2019-06-28

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6950	-1.00	1.6990	1.7111	1.7899	1.9125	1.6750	1.9125	1.2875
9M	1.6375	-1.00	1.6310	1.6461	1.7520	1.9125	1.6025	1.9125	1.2500
1Y	1.5875	-1.50	1.5775	1.5943	1.7170	1.9200	1.5325	1.9200	1.2200
1.5Y	1.5300	-1.75	1.5160	1.5278	1.6663	2.0250	1.4500	2.0250	1.1900
2Y	1.4775	-2.00	1.4650	1.4820	1.6235	2.1150	1.3975	2.1150	1.1675
3Y	1.4400	-1.50	1.4205	1.4361	1.5858	2.2225	1.3475	2.2225	1.1550
4Y	1.4200	-1.50	1.4025	1.4183	1.5702	2.2900	1.3275	2.2950	1.1575
5Y	1.4125	-1.50	1.3920	1.4053	1.5607	2.3350	1.3150	2.3400	1.1575
7Y	1.4050	-1.50	1.3870	1.3993	1.5562	2.3950	1.3100	2.3950	1.1675
10Y	1.4350	-1.50	1.4185	1.4291	1.5844	2.4850	1.3450	2.4850	1.2125
12Y	1.4550	-1.50	1.4385	1.4514	1.6090	2.5225	1.3650	2.5225	1.2150
15Y	1.4500	-1.50	1.4345	1.4476	1.6117	2.5400	1.3600	2.5400	1.2150
20Y	1.4200	-1.50	1.4075	1.4196	1.5864	2.5600	1.3350	2.6500	1.2150
6*9M	-5.75	0.00	-6.80	-6.50	-3.79	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-5.00	-0.50	-5.35	-5.19	-3.50	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-11.00	-0.50	-11.25	-11.23	-9.35	23.00	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-3.75	0.50	-4.45	-4.59	-3.77	12.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-5.75	0.50	-6.25	-6.38	-5.33	20.50	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-6.50	0.50	-7.30	-7.68	-6.28	26.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.00	0.00	-1.80	-1.79	-1.56	8.25	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-2.75	0.00	-2.85	-3.09	-2.50	14.00	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.75	0.00	-1.05	-1.30	-0.95	6.00	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.75	0.00	-0.50	-0.60	-0.45	6.75	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	2.25	0.00	2.65	2.39	2.37	16.25	0.50	30.75	0.50
7*10Y	3.00	0.00	3.15	2.99	2.82	9.50	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.23	2.46	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	1.50	0.00	1.60	1.85	2.73	6.75	1.50	13.00	-0.75
10*20Y	-1.50	0.00	-1.10	-0.95	0.20	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.542	-1.40	1.541	1.558	1.669	1.935	1.509	1.935	1.237
1.5Y	1.544	-1.30	1.542	1.552	1.668	2.113	1.504	2.113	1.232
2Y	1.517	-1.80	1.516	1.532	1.661	2.219	1.477	2.230	1.225
3Y	1.465	-2.50	1.473	1.497	1.636	2.315	1.422	2.315	1.200
4Y	1.522	-2.50	1.525	1.545	1.687	2.502	1.470	2.502	1.232
5Y	1.505	-2.70	1.508	1.530	1.672	2.592	1.452	2.602	1.217
7Y	1.581	-2.70	1.584	1.605	1.750	2.719	1.536	2.728	1.270
10Y	1.595	-2.70	1.596	1.621	1.779	2.815	1.550	2.815	1.355
20Y	1.627	-2.00	1.628	1.662	1.812	2.792	1.585	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.78	0.00
CALL	1.83	6.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.40	0.07	110.42	110.43	110.36
LKTB	131.25	0.23	131.39	131.39	131.12

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	4.55	-0.10	3.67	3.63	4.79	7.85	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	-1.40	-0.45	-2.60	-2.42	-0.17	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-3.95	-0.20	-5.12	-4.98	-3.78	-0.25	-15.70	-0.25	-25.15
3Y	-2.50	1.00	-5.25	-6.09	-4.99	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.20	1.00	-12.27	-12.65	-11.70	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.25	1.20	-11.62	-12.48	-11.13	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.60	1.20	-19.66	-20.61	-19.40	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.00	1.20	-17.77	-19.14	-19.44	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-20.70	0.50	-22.01	-24.19	-22.53	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-75.75	3.50
-74.00	5.25
-75.25	5.50
-79.50	4.50
-78.00	4.00
-78.25	4.00
-72.50	4.00
-58.50	4.00

CRS

USD/KRW 1154.70 (-3.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8300	2.00	1.4750	0.7450	1*2Y	-10.50	1.50
1.5Y	0.7900	3.50	1.5250	1.1500	2*3Y	-8.00	-0.50
2Y	0.7250	3.50	1.5650	1.1900	2*5Y	-9.50	-1.00
3Y	0.6450	3.00	1.6550	0.5450	3*4Y	-0.50	-0.50
4Y	0.6400	2.50	1.7200	0.5500	3*5Y	-1.50	-0.50
5Y	0.6300	2.50	1.7800	0.5550	4*5Y	-1.00	0.00
7Y	0.6800	2.50	1.8950	0.6200	5*7Y	5.00	0.00
10Y	0.8500	2.50	2.0500	0.7900	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	1.7529	0.0124	1.7405	1.7642	1.7359	2.9773	1.7359	2.9773	0.4800
10Y	2.0061	-0.0072	2.0133	2.0487	1.9877	3.2382	1.9877	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	23.59	3.04	20.55	23.92	21.69	103.03	-12.50	103.03	-130.00
10Y	41.11	1.98	39.13	44.67	39.07	98.82	4.82	98.82	-47.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-4.25	0.50	-4.75	-5.25	-4.75	42.25	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	7.80	-0.90	8.70	7.70	7.80	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	25.32	-1.96	27.28	28.45	25.18	79.07	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	52.75/53.25		
02Y	47.75	SPRD	1y*1.5y -5.75
03Y	43.75		3y*4y -2
04Y			
05Y	40.25/40.5		
07Y	41.40.75		
10Y	43/43.5/43.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	152 건	17	135	120	100	34	137	153
금 액	55,971 억원	8,011	47,960	31,554	32,342	10,964	46,825	49,125

장중동향

국고채 금리, 국내 산업생산 지표 부진과 전일 미 국채 금리 하락영향으로 하락.

IRS, 전 구간 하락.
장중에도 비드가 좀 더 우위를 보이며 채권 현,선물 대비 하락폭은 적었음.

CRS, 전 구간 상승.