

IPS Daily Morning Brief

2019-06-12

종가 기준일 2019-06-11

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7250	-0.50	1.7260	1.7789	1.8284	1.9125	1.6750	2.0175	1.2875
9M	1.6750	-0.50	1.6760	1.7358	1.8007	1.9125	1.6750	1.9925	1.2500
1Y	1.6350	-0.50	1.6360	1.6981	1.7722	1.9200	1.6350	1.9700	1.2200
1.5Y	1.5750	-0.25	1.5725	1.6414	1.7259	2.0250	1.5700	2.0250	1.1900
2Y	1.5375	0.00	1.5315	1.5988	1.6853	2.1150	1.5275	2.1150	1.1675
3Y	1.4925	0.00	1.4850	1.5591	1.6501	2.2225	1.4800	2.2225	1.1550
4Y	1.4750	0.25	1.4640	1.5409	1.6335	2.2950	1.4575	2.2950	1.1575
5Y	1.4625	0.50	1.4480	1.5295	1.6247	2.3400	1.4400	2.3400	1.1575
7Y	1.4600	1.00	1.4390	1.5211	1.6195	2.3950	1.4275	2.3950	1.1675
10Y	1.4900	1.25	1.4645	1.5479	1.6457	2.4850	1.4500	2.4850	1.2125
12Y	1.5125	0.75	1.4910	1.5746	1.6713	2.5225	1.4775	2.5225	1.2150
15Y	1.5100	0.75	1.4885	1.5774	1.6758	2.5400	1.4750	2.5400	1.2150
20Y	1.4775	0.75	1.4575	1.5498	1.6514	2.5600	1.4450	2.6500	1.2150

6*9M	-5.00	0.00	-5.00	-4.31	-2.77	8.50	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-4.00	0.00	-4.00	-3.76	-2.85	8.25	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-9.75	0.50	-10.45	-9.94	-8.69	23.00	-12.00	23.00	-12.00
2*3Y	-4.50	0.00	-4.65	-3.96	-3.52	13.25	-4.75	13.25	-4.75
2*4Y	-6.25	0.25	-6.75	-5.79	-5.18	21.75	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-7.50	0.50	-8.35	-6.93	-6.06	27.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.75	0.25	-2.10	-1.83	-1.66	8.50	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-3.00	0.50	-3.70	-2.96	-2.54	14.00	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.25	0.25	-1.60	-1.14	-0.88	6.00	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.25	0.50	-0.90	-0.84	-0.52	7.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	2.75	0.75	1.65	1.84	2.10	16.25	0.50	30.75	0.50
7*10Y	3.00	0.25	2.55	2.68	2.61	9.50	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.25	-0.50	2.65	2.68	2.56	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	2.00	-0.50	2.40	2.95	3.01	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	-1.25	-0.50	-0.70	0.19	0.58	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.587	-0.10	1.598	1.649	1.724	1.935	1.587	1.983	1.237
1.5Y	1.582	0.20	1.581	1.642	1.723	2.113	1.580	2.113	1.232
2Y	1.565	0.50	1.561	1.641	1.718	2.230	1.555	2.230	1.225
3Y	1.532	0.20	1.534	1.612	1.694	2.315	1.530	2.315	1.200
4Y	1.585	0.30	1.580	1.662	1.746	2.502	1.575	2.502	1.232
5Y	1.580	0.30	1.570	1.647	1.729	2.602	1.565	2.602	1.217
7Y	1.661	0.80	1.639	1.722	1.809	2.728	1.627	2.728	1.270
10Y	1.672	1.00	1.658	1.750	1.841	2.815	1.650	2.815	1.355
20Y	1.727	1.20	1.703	1.788	1.871	2.792	1.690	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.82	0.00
CALL	1.74	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.07	-0.02	110.09	110.11	110.04
LKTb	130.32	-0.15	130.45	130.54	130.24

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	4.80	-0.40	3.82	4.95	4.84	7.85	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	-0.70	-0.45	-0.89	-0.05	0.29	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-2.75	-0.50	-2.97	-4.19	-3.32	-0.25	-15.70	-0.25	-25.15
3Y	-3.95	-0.20	-4.94	-5.32	-4.35	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.00	-0.05	-11.64	-12.16	-11.28	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-11.75	0.20	-12.24	-11.74	-10.45	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-20.10	0.20	-20.04	-20.12	-18.91	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-18.20	0.25	-19.33	-20.18	-19.55	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-24.95	-0.45	-24.59	-23.87	-22.01	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1180.40 (-4.80)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-72.00	6.00	1Y	0.9150	5.50	1.4750	0.8000	1*2Y	-16.50	-1.50		
-73.00	5.25	1.5Y	0.8450	5.00	1.5250	1.1650	2*3Y	-4.00	-1.00		
-78.75	4.00	2Y	0.7500	4.00	1.5650	1.2550	2*5Y	-2.50	-1.00		
-78.25	3.00	3Y	0.7100	3.00	1.6550	0.6400	3*4Y	2.00	0.00		
-74.50	2.75	4Y	0.7300	3.00	1.7200	0.6550	3*5Y	1.50	0.00		
-73.75	2.50	5Y	0.7250	3.00	1.7800	0.6500	4*5Y	-0.50	0.00		
-65.00	2.00	7Y	0.8100	3.00	1.8950	0.7350	5*7Y	8.50	0.00		
-53.00	1.75	10Y	0.9600	3.00	2.0500	0.8850	5*10Y	23.50	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	1.9378	0.0119	1.9259	1.8615	1.8867	2.9773	1.8317	2.9773	0.4800
10Y	2.1407	-0.0053	2.1460	2.0846	2.1202	3.2382	2.0719	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	37.28	0.69	36.59	30.65	32.37	103.03	-15.48	103.03	-137.60
10Y	46.87	-1.53	48.40	42.96	47.02	98.82	-10.51	98.82	-47.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-4.75	1.25	-6.00	-7.25	-7.75	42.50	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	10.70	0.50	10.20	10.00	8.70	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	20.29	-1.72	22.01	22.31	23.35	79.07	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M									
09M									
01Y	67.5								
1.5Y	57.25								
02Y									
03Y									
04Y									
05Y	45.75 / 46								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1.5y CCS 85 3y CCS 71 5y CCS 73.5								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			103 건	44	59	39	82	82	97
금 액			37,388 억원	18,795	18,593	8,170	27,165	27,165	38,705

장중동향
국고채 금리, 미 국채 금리 상승과 국채선물 롤오버 등 영향으로 금리 상승. 커브 스티프닝.

IRS, 보합권에서 금리 혼조세. 1.5Y 이하 구간에서 금리 하락. 커브 스티프닝.
단기는 CD금리가 낮아질 것이라는 전망에 상대적으로 오퍼리시한 모습.

CRS, 전 구간 금리 상승.