

IPS Daily Morning Brief

2019-06-14

종가 기준일 2019-06-13

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7050	0.25	1.7175	1.7674	1.8220	1.9125	1.6750	2.0125	1.2875
9M	1.6425	0.25	1.6625	1.7211	1.7925	1.9125	1.6400	1.9775	1.2500
1Y	1.5900	0.50	1.6170	1.6805	1.7626	1.9200	1.5850	1.9475	1.2200
1.5Y	1.5225	0.50	1.5525	1.6209	1.7149	2.0250	1.5175	2.0250	1.1900
2Y	1.4800	0.75	1.5110	1.5779	1.6737	2.1150	1.4725	2.1150	1.1675
3Y	1.4325	1.00	1.4640	1.5364	1.6381	2.2225	1.4225	2.2225	1.1550
4Y	1.4200	1.50	1.4460	1.5179	1.6217	2.2950	1.4050	2.2950	1.1575
5Y	1.4100	1.75	1.4325	1.5060	1.6128	2.3400	1.3925	2.3400	1.1575
7Y	1.4050	1.75	1.4265	1.4978	1.6078	2.3950	1.3875	2.3950	1.1675
10Y	1.4350	2.25	1.4540	1.5244	1.6339	2.4850	1.4125	2.4850	1.2125
12Y	1.4550	2.00	1.4780	1.5505	1.6593	2.5225	1.4350	2.5225	1.2150
15Y	1.4500	2.00	1.4745	1.5520	1.6634	2.5400	1.4300	2.5400	1.2150
20Y	1.4225	2.00	1.4445	1.5236	1.6387	2.5600	1.4025	2.6500	1.2150

6*9M	-6.25	0.00	-5.50	-4.63	-2.96	8.50	-6.25	12.50	-6.25
9*12M	-5.25	0.25	-4.55	-4.06	-2.99	8.25	-5.50	10.50	-5.50
1*2Y	-11.00	0.25	-10.60	-10.26	-8.89	23.00	-12.00	23.00	-12.00
2*3Y	-4.75	0.25	-4.70	-4.15	-3.56	13.25	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-6.00	0.75	-6.50	-6.00	-5.20	21.75	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-7.00	1.00	-7.85	-7.19	-6.09	27.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.25	0.50	-1.80	-1.85	-1.64	8.50	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-2.25	0.75	-3.15	-3.04	-2.53	14.00	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.00	0.25	-1.35	-1.19	-0.89	6.00	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.50	0.00	-0.60	-0.82	-0.50	7.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	2.50	0.50	2.15	1.84	2.11	16.25	0.50	30.75	0.50
7*10Y	3.00	0.50	2.75	2.66	2.62	9.50	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	-0.25	2.40	2.61	2.54	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	1.50	-0.25	2.05	2.76	2.95	6.75	1.50	13.00	-0.75
10*20Y	-1.25	-0.25	-0.95	-0.07	0.48	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.532	-0.90	1.570	1.633	1.712	1.935	1.532	1.960	1.237
1.5Y	1.532	0.10	1.561	1.625	1.711	2.113	1.531	2.113	1.232
2Y	1.517	0.70	1.541	1.621	1.706	2.230	1.510	2.230	1.225
3Y	1.490	1.80	1.511	1.592	1.683	2.315	1.472	2.315	1.200
4Y	1.542	2.00	1.561	1.641	1.735	2.502	1.522	2.502	1.232
5Y	1.532	2.00	1.553	1.626	1.718	2.602	1.512	2.602	1.217
7Y	1.614	2.30	1.630	1.702	1.798	2.728	1.591	2.728	1.270
10Y	1.627	2.50	1.644	1.727	1.830	2.815	1.602	2.815	1.355
20Y	1.677	1.20	1.696	1.768	1.861	2.792	1.665	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.81	0.00
CALL	1.75	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.18	-0.07	110.24	110.35	110.18
LKTb	130.80	-0.29	131.06	131.35	130.80

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	5.80	1.40	4.66	4.75	5.01	7.85	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	-0.95	0.40	-0.87	-0.45	0.37	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-3.70	0.05	-3.04	-4.30	-3.23	-0.25	-15.70	-0.25	-25.15
3Y	-5.75	-0.80	-4.68	-5.53	-4.48	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-12.20	-0.50	-11.52	-12.32	-11.35	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.20	-0.25	-12.07	-12.01	-10.55	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-20.90	-0.55	-20.31	-20.40	-18.98	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.20	-0.25	-18.96	-20.27	-19.57	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-25.45	0.80	-25.13	-24.45	-22.26	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1183.10 (+0.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-75.00	-4.50	1Y	0.8400	-4.00	1.4750	0.8000	1*2Y	-15.00	0.50		
-75.25	-5.00	1.5Y	0.7700	-4.50	1.5250	1.1650	2*3Y	-3.50	0.50		
-79.00	-4.25	2Y	0.6900	-3.50	1.5650	1.2500	2*5Y	-1.00	1.50		
-77.75	-4.00	3Y	0.6550	-3.00	1.6550	0.6400	3*4Y	3.00	1.00		
-73.50	-3.50	4Y	0.6850	-2.00	1.7200	0.6550	3*5Y	2.50	1.00		
-73.00	-3.75	5Y	0.6800	-2.00	1.7800	0.6500	4*5Y	-0.50	0.00		
-63.50	-3.75	7Y	0.7700	-2.00	1.8950	0.7350	5*7Y	9.00	0.00		
-51.50	-4.25	10Y	0.9200	-2.00	2.0500	0.8850	5*10Y	24.00	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	1.8397	-0.0328	1.8725	1.9378	1.9259	2.9773	1.8317	2.9773	0.4800
10Y	2.0964	-0.0217	2.1181	2.1407	2.1460	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	32.27	-3.98	36.25	37.28	36.59	103.03	-15.48	103.03	-130.70
10Y	46.94	-4.67	51.61	46.87	48.40	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	-4.50	1.50	-6.00	-4.75	-6.00	42.50	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	11.00	1.80	9.20	10.70	10.20	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	25.67	1.11	24.56	20.29	22.01	79.07	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M									
09M									
01Y	58.25								
1.5Y									
02Y									
03Y									
04Y	40/40.25								
05Y	38								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y 65/66.5/65.5								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			84 건	-31	115	103	59	39	82
금 액			28,080 억원	-11,264	39,344	37,388	18,593	8,170	27,165

장중동향

국고채 금리, 레벨 부담과 외인의 국채선물 매도 영향으로 전일 금리 하락을 일부 되돌리며 상승 마감.

IRS, 레벨 부담에 금리 상승. 커브 스티프닝.
단기구간은 오퍼리시, 장기 구간은 비디시한 모습.

CRS, 금리 하락 마감.