

IPS Daily Morning Brief

2019-06-27

종가 기준일 2019-06-26

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7000	-0.25	1.6975	1.7194	1.7952	1.9125	1.6750	1.9125	1.2875
9M	1.6300	0.00	1.6170	1.6554	1.7584	1.9125	1.6025	1.9125	1.2500
1Y	1.5825	1.00	1.5545	1.6040	1.7239	1.9200	1.5325	1.9200	1.2200
1.5Y	1.5200	1.00	1.4840	1.5361	1.6733	2.0250	1.4500	2.0250	1.1900
2Y	1.4700	1.00	1.4325	1.4911	1.6308	2.1150	1.3975	2.1150	1.1675
3Y	1.4250	1.25	1.3840	1.4448	1.5935	2.2225	1.3475	2.2225	1.1550
4Y	1.4050	0.75	1.3670	1.4263	1.5778	2.2900	1.3275	2.2950	1.1575
5Y	1.3925	0.75	1.3545	1.4121	1.5684	2.3350	1.3150	2.3400	1.1575
7Y	1.3875	0.75	1.3515	1.4055	1.5642	2.3950	1.3100	2.3950	1.1675
10Y	1.4175	0.50	1.3850	1.4348	1.5922	2.4850	1.3450	2.4850	1.2125
12Y	1.4375	0.50	1.4050	1.4575	1.6168	2.5225	1.3650	2.5225	1.2150
15Y	1.4325	0.25	1.4015	1.4543	1.6198	2.5400	1.3600	2.5400	1.2150
20Y	1.4075	0.25	1.3765	1.4265	1.5945	2.5600	1.3350	2.6500	1.2150

6*9M	-7.00	0.25	-8.05	-6.40	-3.68	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.75	1.00	-6.25	-5.14	-3.45	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-11.25	0.00	-12.20	-11.29	-9.31	23.00	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-4.50	0.25	-4.85	-4.64	-3.73	13.25	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-6.50	-0.25	-6.55	-6.49	-5.30	21.75	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-7.75	-0.25	-7.80	-7.90	-6.24	27.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.00	-0.50	-1.70	-1.85	-1.56	8.50	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-3.25	-0.50	-2.95	-3.26	-2.50	14.00	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.25	0.00	-1.25	-1.41	-0.94	6.00	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.50	0.00	-0.30	-0.66	-0.42	7.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	2.50	-0.25	3.05	2.26	2.38	16.25	0.50	30.75	0.50
7*10Y	3.00	-0.25	3.35	2.93	2.80	9.50	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.28	2.47	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	1.50	-0.25	1.65	1.95	2.76	6.75	1.50	13.00	-0.75
10*20Y	-1.00	-0.25	-0.85	-0.82	0.23	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.546	0.80	1.527	1.567	1.676	1.935	1.509	1.935	1.237
1.5Y	1.548	0.70	1.525	1.560	1.675	2.113	1.504	2.113	1.232
2Y	1.525	0.60	1.499	1.542	1.668	2.219	1.477	2.230	1.225
3Y	1.485	0.30	1.455	1.509	1.644	2.315	1.422	2.315	1.200
4Y	1.536	0.70	1.504	1.555	1.695	2.502	1.470	2.502	1.232
5Y	1.517	0.50	1.486	1.540	1.680	2.592	1.452	2.602	1.217
7Y	1.591	0.50	1.564	1.614	1.759	2.719	1.536	2.728	1.270
10Y	1.602	0.50	1.577	1.630	1.788	2.815	1.550	2.815	1.355
20Y	1.632	0.70	1.612	1.672	1.821	2.792	1.585	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.78	-1.00
CALL	1.76	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.38	-0.01	110.41	110.41	110.31
LKTb	131.29	-0.02	131.35	131.43	131.06

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	3.65	0.20	2.77	3.67	4.82	7.85	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	-2.80	0.30	-4.14	-2.41	-0.13	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-5.50	0.40	-6.67	-5.04	-3.75	-0.25	-15.70	-0.25	-25.15
3Y	-6.00	0.95	-7.12	-6.45	-5.04	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-13.10	0.05	-13.68	-12.91	-11.75	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-12.45	0.25	-13.17	-12.80	-11.18	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-20.35	0.25	-21.27	-20.89	-19.44	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-18.45	0.00	-19.18	-19.54	-19.57	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-22.45	-0.45	-23.53	-24.51	-22.67	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1156.60 (+0.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-79.75	2.00	1Y	0.7850	3.00	1.4750	0.7450	1*2Y	-13.00	-2.50		
-80.00	0.00	1.5Y	0.7200	1.00	1.5250	1.1600	2*3Y	-7.50	-0.50		
-81.50	-0.50	2Y	0.6550	0.50	1.5650	1.2100	2*5Y	-8.50	-2.00		
-84.50	-1.25	3Y	0.5800	0.00	1.6550	0.5450	3*4Y	0.00	-0.50		
-82.50	-1.25	4Y	0.5800	-0.50	1.7200	0.5500	3*5Y	-1.00	-1.50		
-82.25	-2.25	5Y	0.5700	-1.50	1.7800	0.5550	4*5Y	-1.00	-1.00		
-76.25	-2.75	7Y	0.6250	-2.00	1.8950	0.6200	5*7Y	5.50	-0.50		
-62.25	-3.00	10Y	0.7950	-2.50	2.0500	0.7900	5*10Y	22.50	-1.00		

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	1.7642	0.0283	1.7359	1.7365	1.7617	2.9773	1.7359	2.9773	0.4800
10Y	2.0487	0.0610	1.9877	2.0213	2.0585	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	23.92	2.23	21.69	25.15	27.17	103.03	-15.48	103.03	-130.00
10Y	44.67	5.60	39.07	45.63	48.85	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	-5.25	-0.50	-4.75	-4.25	-4.25	42.50	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	7.70	-0.10	7.80	8.00	8.00	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	28.45	3.27	25.18	28.48	29.68	79.07	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	46.5/48/47.75	SPRD							
03Y									
04Y									
05Y	40.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y 66/65.5 3y 58								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			120 건	20	100	34	137	153	109
금 액			31,554 억원	-788	32,342	10,964	46,825	49,125	36,853

장중동향
국고채 금리, 한미 금리 인하 기대 후퇴와 증권, 외인의 국채 선물 매도로 상승.

IRS, 현물 금리상승을 반영하며 전 구간 상승.
다만, 현물 상승을 모두 반영하지는 못했음.

CRS, 단기구간 상승, 장기구간 하락, 컵플래트닝.