

IPS Daily Morning Brief

2019-06-28

종가 기준일 2019-06-27

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.7050	0.50	1.7000	1.7148	1.7926	1.9125	1.6750	1.9125	1.2875
9M	1.6475	1.75	1.6260	1.6503	1.7553	1.9125	1.6025	1.9125	1.2500
1Y	1.6025	2.00	1.5685	1.5988	1.7206	1.9200	1.5325	1.9200	1.2200
1.5Y	1.5475	2.75	1.5035	1.5315	1.6701	2.0250	1.4500	2.0250	1.1900
2Y	1.4975	2.75	1.4525	1.4861	1.6275	2.1150	1.3975	2.1150	1.1675
3Y	1.4550	3.00	1.4055	1.4398	1.5899	2.2225	1.3475	2.2225	1.1550
4Y	1.4350	3.00	1.3885	1.4214	1.5743	2.2900	1.3275	2.2950	1.1575
5Y	1.4275	3.50	1.3770	1.4076	1.5648	2.3350	1.3150	2.3400	1.1575
7Y	1.4200	3.25	1.3735	1.4011	1.5605	2.3950	1.3100	2.3950	1.1675
10Y	1.4500	3.25	1.4060	1.4306	1.5886	2.4850	1.3450	2.4850	1.2125
12Y	1.4700	3.25	1.4260	1.4531	1.6133	2.5225	1.3650	2.5225	1.2150
15Y	1.4650	3.25	1.4225	1.4496	1.6161	2.5400	1.3600	2.5400	1.2150
20Y	1.4350	2.75	1.3965	1.4218	1.5908	2.5600	1.3350	2.6500	1.2150

6*9M	-5.75	1.25	-7.40	-6.45	-3.73	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.50	0.25	-5.75	-5.15	-3.47	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-10.50	0.75	-11.60	-11.26	-9.31	23.00	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-4.25	0.25	-4.70	-4.64	-3.76	12.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-6.25	0.25	-6.40	-6.48	-5.32	20.50	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-7.00	0.75	-7.55	-7.85	-6.27	26.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.00	0.00	-1.70	-1.84	-1.56	8.25	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-2.75	0.50	-2.85	-3.21	-2.51	14.00	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.75	0.50	-1.15	-1.38	-0.95	6.00	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.75	-0.25	-0.35	-0.65	-0.43	6.75	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	2.25	-0.25	2.90	2.30	2.38	16.25	0.50	30.75	0.50
7*10Y	3.00	0.00	3.25	2.95	2.81	9.50	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.25	2.46	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	1.50	0.00	1.65	1.90	2.75	6.75	1.50	13.00	-0.75
10*20Y	-1.50	-0.50	-0.95	-0.89	0.22	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.556	1.00	1.536	1.562	1.673	1.935	1.509	1.935	1.237
1.5Y	1.557	0.90	1.536	1.555	1.672	2.113	1.504	2.113	1.232
2Y	1.535	1.00	1.511	1.536	1.665	2.219	1.477	2.230	1.225
3Y	1.490	0.50	1.469	1.502	1.640	2.315	1.422	2.315	1.200
4Y	1.547	1.10	1.519	1.549	1.692	2.502	1.470	2.502	1.232
5Y	1.532	1.50	1.502	1.534	1.677	2.592	1.452	2.602	1.217
7Y	1.608	1.70	1.579	1.609	1.755	2.719	1.536	2.728	1.270
10Y	1.622	2.00	1.591	1.624	1.784	2.815	1.550	2.815	1.355
20Y	1.647	1.50	1.624	1.665	1.817	2.792	1.585	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.78	0.00
CALL	1.77	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.33	-0.05	110.33	110.35	110.30
LKTb	131.02	-0.27	131.05	131.21	131.01

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	4.65	1.00	3.23	3.68	4.81	7.85	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	-0.95	1.85	-3.25	-2.36	-0.14	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-3.75	1.75	-5.83	-4.96	-3.75	-0.25	-15.70	-0.25	-25.15
3Y	-3.50	2.50	-6.33	-6.25	-5.02	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.20	1.90	-13.07	-12.78	-11.73	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.45	2.00	-12.52	-12.66	-11.17	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-18.80	1.55	-20.51	-20.78	-19.43	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-17.20	1.25	-18.52	-19.36	-19.51	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-21.20	1.25	-22.77	-24.34	-22.59	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1158.10 (+1.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-79.25	0.50	1Y	0.8100	2.50	1.4750	0.7450	1*2Y	-12.00	1.00		
-79.25	0.75	1.5Y	0.7550	3.50	1.5250	1.1600	2*3Y	-7.50	0.00		
-80.75	0.75	2Y	0.6900	3.50	1.5650	1.2100	2*5Y	-8.50	0.00		
-84.00	0.50	3Y	0.6150	3.50	1.6550	0.5450	3*4Y	0.00	0.00		
-82.00	0.50	4Y	0.6150	3.50	1.7200	0.5500	3*5Y	-1.00	0.00		
-82.25	0.00	5Y	0.6050	3.50	1.7800	0.5550	4*5Y	-1.00	0.00		
-76.50	-0.25	7Y	0.6550	3.00	1.8950	0.6200	5*7Y	5.00	-0.50		
-62.50	-0.25	10Y	0.8250	3.00	2.0500	0.7900	5*10Y	22.00	-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	1.7405	-0.0237	1.7642	1.7359	1.7365	2.9773	1.7359	2.9773	0.4800
10Y	2.0133	-0.0354	2.0487	1.9877	2.0213	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	20.55	-3.37	23.92	21.69	25.15	103.03	-12.50	103.03	-130.00
10Y	39.13	-5.54	44.67	39.07	45.63	98.82	3.89	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	0.50	-5.25	-4.75	-4.25	42.25	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	8.70	1.00	7.70	7.80	8.00	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	27.28	-1.17	28.45	25.18	28.48	79.07	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	70.5								
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	49.5/49.75				SPRD	6m*1y	-10.25		
03Y	44.75/45.25/45					9m*1y	-4.75		
04Y	43.5					1y*2y	-10.25		
05Y	41.25/41.5/41.75/42/42.75					2y*4y	-6.5		
07Y						3y*4y	-2		
10Y	45.25					7y*20y	1.75		
12Y									
15Y									
20Y	42.5/43.25								
CRS	2y*3y*4y -7								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	135 건	15	120	100	34	137	153	109	
금 액	47,960 억원	16,406	31,554	32,342	10,964	46,825	49,125	36,853	

장중동향

국고채 금리, 글로벌 금리에 연동해 대부분 구간에서 금리 상승.

IRS, 글로벌 금리 상승에 비드가 우위를 보이며 금리 상승.

CRS, 금리 상승 마감.