

IPS Daily Morning Brief

2019-07-08

종가 기준일 2019-07-05

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6900	0.75	1.6890	1.7001	1.7758	1.9125	1.6825	1.9125	1.2875
9M	1.6150	0.25	1.6235	1.6310	1.7337	1.9125	1.6025	1.9125	1.2500
1Y	1.5600	0.75	1.5665	1.5749	1.6964	1.9200	1.5325	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4875	1.25	1.4990	1.5076	1.6443	2.0250	1.4500	2.0250	1.1900
2Y	1.4275	1.00	1.4435	1.4585	1.6007	2.1150	1.3975	2.1150	1.1675
3Y	1.3825	1.25	1.4000	1.4135	1.5627	2.2225	1.3475	2.2225	1.1550
4Y	1.3625	1.50	1.3790	1.3959	1.5469	2.2900	1.3275	2.2950	1.1575
5Y	1.3450	1.50	1.3635	1.3834	1.5370	2.3350	1.3150	2.3400	1.1575
7Y	1.3425	1.50	1.3605	1.3794	1.5325	2.3950	1.3100	2.3950	1.1675
10Y	1.3750	1.50	1.3925	1.4113	1.5612	2.4850	1.3450	2.4850	1.2125
12Y	1.3950	1.50	1.4125	1.4319	1.5855	2.5225	1.3650	2.5225	1.2150
15Y	1.3900	1.50	1.4075	1.4275	1.5877	2.5400	1.3600	2.5400	1.2150
20Y	1.3600	1.50	1.3775	1.3993	1.5623	2.5600	1.3350	2.6500	1.2150

6*9M	-7.50	-0.50	-6.55	-6.91	-4.21	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-5.50	0.50	-5.70	-5.61	-3.73	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-13.25	0.25	-12.30	-11.64	-9.57	23.00	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-4.50	0.25	-4.35	-4.50	-3.80	12.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-6.50	0.50	-6.45	-6.26	-5.38	20.50	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-8.25	0.50	-8.00	-7.51	-6.37	26.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.00	0.25	-2.10	-1.76	-1.58	8.25	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-3.75	0.25	-3.65	-3.01	-2.56	14.00	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.75	0.00	-1.55	-1.25	-0.98	6.00	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.25	0.00	-0.30	-0.40	-0.46	6.75	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	3.00	0.00	2.90	2.79	2.42	16.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	3.25	0.00	3.20	3.19	2.88	9.25	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.06	2.43	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	1.50	0.00	1.50	1.63	2.65	6.75	1.50	13.00	-0.75
10*20Y	-1.50	0.00	-1.50	-1.20	0.11	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.480	-0.70	1.509	1.533	1.648	1.935	1.480	1.935	1.237
1.5Y	1.487	-1.00	1.514	1.533	1.648	2.113	1.487	2.113	1.232
2Y	1.462	0.00	1.487	1.510	1.640	2.219	1.462	2.230	1.225
3Y	1.421	0.90	1.441	1.470	1.612	2.315	1.412	2.315	1.200
4Y	1.470	0.80	1.493	1.520	1.663	2.502	1.462	2.502	1.232
5Y	1.450	1.00	1.474	1.504	1.648	2.592	1.440	2.602	1.217
7Y	1.524	1.40	1.544	1.581	1.726	2.719	1.510	2.728	1.270
10Y	1.537	1.70	1.555	1.593	1.752	2.815	1.520	2.815	1.355
20Y	1.567	1.00	1.588	1.633	1.786	2.792	1.557	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.78	0.00
CALL	1.73	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.54	-0.04	110.57	110.65	110.53
LKTb	131.92	-0.18	132.07	132.27	131.88

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	8.00	1.45	5.79	4.23	4.85	8.00	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	0.05	2.25	-1.54	-2.50	-0.35	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-3.45	1.00	-4.37	-5.15	-3.95	-0.25	-15.20	-0.25	-25.15
3Y	-3.85	0.35	-4.06	-5.62	-4.90	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.75	0.70	-11.42	-12.42	-11.65	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.50	0.50	-11.07	-12.11	-11.10	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-18.15	0.10	-18.33	-20.18	-19.33	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.20	-0.20	-16.21	-18.17	-19.10	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-20.70	0.50	-21.07	-23.34	-22.38	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1170.40 (+1.80)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-68.00	-0.75	1Y	0.8800	0.00	1.4750	0.7450	1*2Y	-12.50	0.50		
-65.75	-0.75	1.5Y	0.8300	0.50	1.5250	1.1100	2*3Y	-7.50	1.00		
-67.25	-0.50	2Y	0.7550	0.50	1.5650	1.1400	2*5Y	-6.50	1.50		
-70.25	0.25	3Y	0.6800	1.50	1.6550	0.5450	3*4Y	0.50	0.50		
-67.75	0.50	4Y	0.6850	2.00	1.7200	0.5500	3*5Y	1.00	0.50		
-65.50	0.50	5Y	0.6900	2.00	1.7800	0.5550	4*5Y	0.50	0.00		
-62.25	0.50	7Y	0.7200	2.00	1.8950	0.6200	5*7Y	3.00	0.00		
-49.50	0.50	10Y	0.8800	2.00	2.0500	0.7900	5*10Y	19.00	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	1.8633	0.1057	1.7576	1.7576	1.7573	2.9773	1.7359	2.9773	0.4800
10Y	2.0367	0.0866	1.9501	1.9501	1.9750	3.2382	1.9501	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	40.13	10.57	29.56	28.06	25.03	103.03	-1.14	103.03	-130.00
10Y	49.97	6.96	43.01	42.81	39.30	98.82	6.99	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	-5.75	-5.50	-5.00	42.25	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	7.50	1.70	5.80	4.50	7.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	17.34	-1.91	19.25	19.25	21.77	73.81	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M	68.5								
09M									
01Y	54.75 / 55.25 / 56								
1.5Y									
02Y	41								
03Y	36 / 38.25	SPRD	1*2Y		-14				
04Y	33.75		2*3Y		-4.75				
05Y			2*4Y		-6.75				
07Y			2*5Y		-8.5				
10Y	37.25		5*10Y		03				
12Y			7*10Y		3.25				
15Y									
20Y									
CRS	1*5Y CCS -0.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	102 건	7	95	101	96	54	152	135	
금 액	35,914 억원	-176	36,090	37,060	40,625	16,195	55,971	47,960	

장중동향
국고채 금리, 외인 10년 국채선물 매도 영향으로 금리 상승.

IRS, 현물에 연동되면서 등락을 거듭하다 금리 상승 마감. 커브 스티프닝.

CRS, 1.5Y 이상 구간에서 금리 상승.