

IPS Daily Morning Brief

2019-07-09

종가 기준일 2019-07-08

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6875	-0.25	1.6875	1.6980	1.7729	1.9125	1.6825	1.9125	1.2875
9M	1.6150	0.00	1.6185	1.6278	1.7297	1.9125	1.6025	1.9125	1.2500
1Y	1.5600	0.00	1.5605	1.5709	1.6918	1.9200	1.5325	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4850	-0.25	1.4890	1.5030	1.6390	2.0250	1.4500	2.0250	1.1900
2Y	1.4250	-0.25	1.4315	1.4529	1.5951	2.1150	1.3975	2.1150	1.1675
3Y	1.3800	-0.25	1.3860	1.4079	1.5569	2.2225	1.3475	2.2225	1.1550
4Y	1.3600	-0.25	1.3650	1.3903	1.5411	2.2900	1.3275	2.2950	1.1575
5Y	1.3425	-0.25	1.3475	1.3776	1.5311	2.3350	1.3150	2.3400	1.1575
7Y	1.3375	-0.50	1.3450	1.3738	1.5265	2.3950	1.3100	2.3950	1.1675
10Y	1.3675	-0.75	1.3770	1.4058	1.5553	2.4850	1.3450	2.4850	1.2125
12Y	1.3875	-0.75	1.3970	1.4260	1.5795	2.5225	1.3650	2.5225	1.2150
15Y	1.3825	-0.75	1.3920	1.4215	1.5816	2.5400	1.3600	2.5400	1.2150
20Y	1.3525	-0.75	1.3620	1.3934	1.5561	2.5600	1.3350	2.6500	1.2150

6*9M	-7.25	0.25	-6.90	-7.03	-4.32	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-5.50	0.00	-5.80	-5.69	-3.80	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-13.50	-0.25	-12.90	-11.80	-9.67	23.00	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-4.50	0.00	-4.55	-4.50	-3.82	12.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-6.50	0.00	-6.65	-6.26	-5.40	20.50	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-8.25	0.00	-8.40	-7.53	-6.40	26.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.00	0.00	-2.10	-1.76	-1.58	8.25	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-3.75	0.00	-3.85	-3.03	-2.58	14.00	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.75	0.00	-1.75	-1.26	-1.00	6.00	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.50	-0.25	-0.25	-0.39	-0.46	6.75	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	2.50	-0.50	2.95	2.81	2.42	16.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	3.00	-0.25	3.20	3.20	2.88	9.25	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.03	2.42	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	1.50	0.00	1.50	1.58	2.63	6.75	1.50	13.00	-0.75
10*20Y	-1.50	0.00	-1.50	-1.24	0.08	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.477	-0.30	1.496	1.527	1.643	1.935	1.477	1.935	1.237
1.5Y	1.480	-0.70	1.501	1.528	1.643	2.113	1.480	2.113	1.232
2Y	1.461	-0.10	1.474	1.505	1.635	2.219	1.461	2.230	1.225
3Y	1.418	-0.30	1.428	1.464	1.606	2.315	1.412	2.315	1.200
4Y	1.461	-0.90	1.477	1.514	1.658	2.502	1.461	2.502	1.232
5Y	1.447	-0.30	1.458	1.498	1.642	2.592	1.440	2.602	1.217
7Y	1.517	-0.70	1.527	1.574	1.720	2.719	1.510	2.728	1.270
10Y	1.530	-0.70	1.538	1.586	1.746	2.815	1.520	2.815	1.355
20Y	1.557	-1.00	1.571	1.625	1.780	2.792	1.557	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.78	0.00
CALL	1.72	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.56	0.02	110.40	110.57	110.43
LKTb	132.02	0.10	131.52	132.02	131.50

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	8.30	0.30	6.49	4.39	4.88	8.30	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	0.50	0.45	-1.22	-2.46	-0.38	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-3.60	-0.15	-4.23	-5.21	-4.00	-0.25	-15.20	-0.25	-25.15
3Y	-3.80	0.05	-4.18	-5.62	-4.90	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.10	0.65	-11.24	-12.38	-11.65	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.45	0.05	-11.07	-12.03	-11.10	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.95	0.20	-18.22	-20.06	-19.32	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.25	-0.05	-16.12	-18.06	-19.03	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-20.45	0.25	-20.86	-23.13	-22.37	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1182.00 (+11.60)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-64.50	3.50	1Y	0.9150	3.50	1.4750	0.7450	1*2Y	-17.50	-5.00	
-66.00	-0.25	1.5Y	0.8250	-0.50	1.5250	1.1100	2*3Y	-6.50	1.00	
-68.50	-1.25	2Y	0.7400	-1.50	1.5650	1.1400	2*5Y	-5.50	1.00	
-70.50	-0.25	3Y	0.6750	-0.50	1.6550	0.5450	3*4Y	0.50	0.00	
-68.00	-0.25	4Y	0.6800	-0.50	1.7200	0.5500	3*5Y	1.00	0.00	
-65.75	-0.25	5Y	0.6850	-0.50	1.7800	0.5550	4*5Y	0.50	0.00	
-62.25	0.00	7Y	0.7150	-0.50	1.8950	0.6200	5*7Y	3.00	0.00	
-49.25	0.25	10Y	0.8750	-0.50	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	1.9002	0.0369	1.8633	1.7576	1.7576	2.9773	1.7359	2.9773	0.4800
10Y	2.0505	0.0138	2.0367	1.9501	1.9501	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	43.92	3.79	40.13	29.56	28.06	103.03	-1.14	103.03	-130.00
10Y	52.05	2.08	49.97	43.01	42.81	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	-5.75	-0.50	-5.25	-5.75	-5.50	42.25	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	6.90	-0.60	7.50	5.80	4.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	15.03	-2.31	17.34	19.25	19.25	72.10	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	57 / 56.75 / 56								
1.5Y	50 / 49.75								
02Y	44.25 / 43.5	SPRD							
03Y									
04Y									
05Y	36.5								
07Y									
10Y	39.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	67 건	-35	102	95	101	96	54	152	
금 액	25,490 억원	-10,424	35,914	36,090	37,060	40,625	16,195	55,971	

장중동향
국고채 금리, 급격한 약세로 출발했으나 대기 매수세 유입으로 금리 하락 마감.

IRS, 중장기 구간을 중심으로 금리 하락.
장중 현물 움직임에 연동되면서 오후 들어 본격 오피 우위 장세.

CRS, 1Y를 제외한 구간에서 금리 하락.