

IPS Daily Morning Brief

2019-07-10

종가 기준일 2019-07-09

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6875	0.00	1.6865	1.6961	1.7700	1.9125	1.6825	1.9125	1.2875
9M	1.6125	-0.25	1.6145	1.6246	1.7257	1.9125	1.6025	1.9125	1.2500
1Y	1.5600	0.00	1.5575	1.5671	1.6871	1.9200	1.5325	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4900	0.50	1.4840	1.4988	1.6337	2.0250	1.4500	2.0250	1.1900
2Y	1.4300	0.50	1.4250	1.4475	1.5895	2.1150	1.3975	2.1150	1.1675
3Y	1.3875	0.75	1.3800	1.4026	1.5512	2.2225	1.3475	2.2225	1.1550
4Y	1.3675	0.75	1.3590	1.3849	1.5353	2.2900	1.3275	2.2950	1.1575
5Y	1.3500	0.75	1.3415	1.3720	1.5251	2.3350	1.3150	2.3400	1.1575
7Y	1.3475	1.00	1.3385	1.3681	1.5204	2.3950	1.3100	2.3950	1.1675
10Y	1.3775	1.00	1.3700	1.4001	1.5493	2.4850	1.3450	2.4850	1.2125
12Y	1.3975	1.00	1.3900	1.4203	1.5734	2.5225	1.3650	2.5225	1.2150
15Y	1.3900	0.75	1.3845	1.4155	1.5754	2.5400	1.3600	2.5400	1.2150
20Y	1.3575	0.50	1.3540	1.3874	1.5498	2.5600	1.3350	2.6500	1.2150

6*9M	-7.50	-0.25	-7.20	-7.15	-4.44	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-5.25	0.25	-5.70	-5.75	-3.86	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-13.00	0.50	-13.25	-11.96	-9.76	23.00	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-4.25	0.25	-4.50	-4.49	-3.83	12.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-6.25	0.25	-6.60	-6.26	-5.42	20.50	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-8.00	0.25	-8.35	-7.55	-6.44	26.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.00	0.00	-2.10	-1.78	-1.59	8.25	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-3.75	0.00	-3.85	-3.06	-2.61	14.00	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.75	0.00	-1.75	-1.29	-1.02	6.00	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.25	0.25	-0.30	-0.39	-0.47	6.75	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	2.75	0.25	2.85	2.81	2.43	16.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	3.00	0.00	3.15	3.20	2.89	9.25	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.01	2.41	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	1.25	-0.25	1.45	1.54	2.60	6.75	1.25	13.00	-0.75
10*20Y	-2.00	-0.50	-1.60	-1.28	0.05	10.25	-2.00	27.50	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.476	-0.10	1.485	1.521	1.638	1.935	1.476	1.935	1.237
1.5Y	1.479	-0.10	1.491	1.522	1.638	2.113	1.479	2.113	1.232
2Y	1.462	0.10	1.465	1.500	1.630	2.219	1.461	2.230	1.225
3Y	1.422	0.40	1.420	1.459	1.600	2.315	1.412	2.315	1.200
4Y	1.465	0.40	1.467	1.508	1.652	2.502	1.461	2.502	1.232
5Y	1.455	0.80	1.449	1.492	1.636	2.592	1.440	2.602	1.217
7Y	1.526	0.90	1.518	1.568	1.714	2.719	1.510	2.728	1.270
10Y	1.540	1.00	1.530	1.580	1.739	2.815	1.520	2.815	1.355
20Y	1.562	0.50	1.561	1.616	1.773	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	110.54	-0.02	110.52	110.60	110.52
LKTb	131.92	-0.10	131.87	132.15	131.85

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	8.40	0.10	7.21	4.57	4.92	8.40	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	1.10	0.60	-0.70	-2.37	-0.41	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-3.20	0.40	-3.98	-5.24	-4.05	-0.25	-15.20	-0.25	-25.15
3Y	-3.45	0.35	-3.98	-5.59	-4.91	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-9.75	0.35	-10.76	-12.31	-11.65	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.50	-0.05	-10.77	-11.97	-11.11	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.85	0.10	-17.99	-19.95	-19.32	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.25	0.00	-15.98	-17.96	-18.97	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-20.45	0.00	-20.66	-22.91	-22.36	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1180.50 (-1.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-66.50	-2.00	1Y	0.8950	-2.00	1.4750	0.7450	1*2Y	-17.50	0.00		
-68.50	-2.50	1.5Y	0.8050	-2.00	1.5250	1.1100	2*3Y	-6.00	0.50		
-71.00	-2.50	2Y	0.7200	-2.00	1.5650	1.1400	2*5Y	-5.00	0.50		
-72.75	-2.25	3Y	0.6600	-1.50	1.6550	0.5450	3*4Y	0.50	0.00		
-70.25	-2.25	4Y	0.6650	-1.50	1.7200	0.5500	3*5Y	1.00	0.00		
-68.00	-2.25	5Y	0.6700	-1.50	1.7800	0.5550	4*5Y	0.50	0.00		
-64.75	-2.50	7Y	0.7000	-1.50	1.8950	0.6200	5*7Y	3.00	0.00		
-51.75	-2.50	10Y	0.8600	-1.50	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	1.9168	0.0166	1.9002	1.8633	1.7576	2.9773	1.7359	2.9773	0.4800
10Y	2.0677	0.0172	2.0505	2.0367	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	45.48	1.56	43.92	40.13	29.56	103.03	-1.14	103.03	-130.00
10Y	52.77	0.72	52.05	49.97	43.01	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	-5.25	-5.75	42.25	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	7.80	0.90	6.90	7.50	5.80	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	15.09	0.06	15.03	17.34	19.25	68.50	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	68.25									
09M	61									
01Y	55.25/56									
1.5Y										
02Y					SPRD	1y*2y -13.25				
03Y						2y*5y -8.25				
04Y	36									
05Y										
07Y										
10Y										
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			74 건	7	67	102	95	101	96	54
금 액			39,269 억원	13,779	25,490	35,914	36,090	37,060	40,625	16,195

장중동향

국고채 금리, 대부분 구간 약보합.

장중 강세와 약세를 오가는 공방.

IRS, 대부분 구간에서 상승과 커브 스티프닝.

CRS, 전 구간 하락.