

IPS Daily Morning Brief

2019-07-15

종가 기준일 2019-07-12

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6725	-0.25	1.6820	1.6925	1.7611	1.9125	1.6725	1.9125	1.2875
9M	1.6000	-0.25	1.6095	1.6204	1.7139	1.9125	1.6000	1.9125	1.2500
1Y	1.5475	-0.25	1.5565	1.5633	1.6734	1.9200	1.5235	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4825	-0.25	1.4885	1.4956	1.6183	2.0250	1.4500	2.0250	1.1900
2Y	1.4275	0.25	1.4300	1.4424	1.5730	2.1150	1.3975	2.1150	1.1675
3Y	1.3900	0.50	1.3890	1.3989	1.5345	2.2225	1.3475	2.2225	1.1550
4Y	1.3750	0.50	1.3720	1.3810	1.5188	2.2900	1.3275	2.2950	1.1575
5Y	1.3675	0.75	1.3595	1.3684	1.5085	2.3350	1.3150	2.3400	1.1575
7Y	1.3675	1.25	1.3565	1.3649	1.5037	2.3900	1.3100	2.3950	1.1675
10Y	1.4000	1.25	1.3880	1.3974	1.5331	2.4800	1.3450	2.4850	1.2125
12Y	1.4200	1.25	1.4080	1.4174	1.5569	2.5175	1.3650	2.5225	1.2150
15Y	1.4125	1.25	1.4010	1.4123	1.5583	2.5350	1.3600	2.5400	1.2150
20Y	1.3800	1.25	1.3690	1.3834	1.5325	2.5550	1.3350	2.6500	1.2150

6*9M	-7.25	0.00	-7.25	-7.21	-4.72	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-5.25	0.00	-5.30	-5.71	-4.05	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-12.00	0.50	-12.65	-12.09	-10.05	22.50	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-3.75	0.25	-4.10	-4.35	-3.85	12.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-5.25	0.25	-5.80	-6.14	-5.41	20.50	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-6.00	0.50	-7.05	-7.40	-6.45	26.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.50	0.00	-1.70	-1.79	-1.57	8.00	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-2.25	0.25	-2.95	-3.05	-2.60	14.00	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.75	0.25	-1.25	-1.26	-1.04	6.00	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	0.00	0.50	-0.30	-0.35	-0.48	6.75	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	3.25	0.50	2.85	2.90	2.46	16.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	3.25	0.00	3.15	3.25	2.94	9.25	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.00	2.38	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	1.25	0.00	1.30	1.49	2.52	6.75	1.25	13.00	-0.75
10*20Y	-2.00	0.00	-1.90	-1.40	-0.06	10.25	-2.00	27.50	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.448	-0.50	1.465	1.510	1.622	1.935	1.448	1.935	1.237
1.5Y	1.452	-0.10	1.468	1.512	1.622	2.113	1.452	2.113	1.232
2Y	1.457	0.20	1.462	1.493	1.615	2.217	1.455	2.230	1.225
3Y	1.420	0.30	1.423	1.451	1.584	2.310	1.412	2.315	1.200
4Y	1.472	0.70	1.470	1.500	1.635	2.502	1.461	2.502	1.232
5Y	1.470	1.00	1.461	1.485	1.620	2.592	1.440	2.602	1.217
7Y	1.545	1.20	1.534	1.560	1.697	2.711	1.510	2.728	1.270
10Y	1.565	1.50	1.550	1.573	1.721	2.815	1.520	2.815	1.355
20Y	1.582	1.50	1.570	1.604	1.756	2.792	1.557	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.78	0.00
CALL	1.74	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.52	-0.01	110.47	110.52	110.44
LKTb	131.65	-0.15	131.50	131.65	131.34

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	9.95	0.25	9.11	5.31	5.12	9.95	-9.65	9.95	-17.75
1.5Y	3.05	-0.15	2.07	-1.66	-0.38	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-2.95	0.05	-3.20	-5.04	-4.17	-0.25	-15.20	-0.25	-25.15
3Y	-3.00	0.20	-3.38	-5.19	-4.91	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-9.70	-0.20	-9.76	-11.93	-11.61	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.25	-0.25	-10.19	-11.66	-11.12	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.75	0.05	-17.73	-19.49	-19.33	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.50	-0.25	-16.20	-17.55	-18.83	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-20.20	-0.25	-20.14	-22.08	-22.33	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1179.20 (+5.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-69.25	0.25	1Y	0.8550	0.00	1.4750	0.7450	1*2Y	-16.50	0.00		
-71.25	0.25	1.5Y	0.7700	0.00	1.5250	1.1100	2*3Y	-7.00	-1.50		
-73.75	-0.25	2Y	0.6900	0.00	1.5650	1.1400	2*5Y	-7.00	-2.50		
-77.00	-2.00	3Y	0.6200	-1.50	1.6550	0.5450	3*4Y	0.00	-1.00		
-75.50	-3.00	4Y	0.6200	-2.50	1.7200	0.5500	3*5Y	0.00	-1.00		
-74.75	-3.25	5Y	0.6200	-2.50	1.7800	0.5550	4*5Y	0.00	0.00		
-71.75	-3.75	7Y	0.6500	-2.50	1.8950	0.6200	5*7Y	3.00	0.00		
-60.00	-3.75	10Y	0.8000	-2.50	2.0500	0.7900	5*10Y	18.00	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	1.8574	-0.0154	1.8728	1.8317	1.9168	2.9773	1.7359	2.9773	0.4800
10Y	2.1240	-0.0150	2.1390	2.0624	2.0677	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	40.04	-1.74	41.78	35.67	45.48	103.03	3.47	103.03	-130.00
10Y	55.90	-3.00	58.90	49.74	52.77	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	-2.75	1.00	-3.75	-3.50	-5.25	42.25	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	10.80	1.30	9.50	9.00	7.80	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	26.66	0.04	26.62	23.07	15.09	68.39	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	60.75								
01Y									
1.5Y									
02Y	43	SPRD	1.5y*2y -5.5						
03Y	40.5/39.5								
04Y									
05Y	38.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	4y 63/62.5/62 3y*5y 1								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	74 건	-24	98	86	74	67	102	95	
금 액	31,052 억원	-9,968	41,020	28,300	39,269	25,490	35,914	36,090	

장중동향
국고채 금리, 장기물 중심 상승.
단기물은 국채선물 중심으로 매수 유입되며 대부분 되돌림.

IRS, 대부분 구간 상승. 1년구간 강보합되며 커브 스티프닝.

CRS, 대부분 구간 하락.