IPS Daily Morning Brief

2019-07-17

종가 기준일 2019-07-16

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6750	0.25	1.6765	1.6895	1.7553	1.9125	1.6725	1.9125	1.2875
9M	1.6000	0.00	1.6040	1.6178	1.7061	1.9125	1.6000	1.9125	1.2500
1Y	1.5425	-0.50	1.5505	1.5610	1.6643	1.9200	1.5325	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4775	-0.50	1.4855	1.4936	1.6079	2.0250	1.4500	2.0250	1.1900
2Y	1.4225	-0.75	1.4295	1.4393	1.5617	2.1150	1.3975	2.1150	1.1675
3Y	1.3850	-1.00	1.3915	1.3963	1.5231	2.2225	1.3475	2.2225	1.1550
4Y	1.3725	-1.00	1.3775	1.3786	1.5075	2.2900	1.3275	2.2950	1.1575
5Y	1.3650	-1.00	1.3690	1.3664	1.4971	2.3350	1.3150	2.3400	1.1575
7Y	1.3675	-0.75	1.3680	1.3633	1.4924	2.3825	1.3100	2.3950	1.1675
10Y	1.4075	-0.75	1.4035	1.3963	1.5223	2.4725	1.3450	2.4850	1.2125
12Y	1.4275	-0.75	1.4235	1.4163	1.5460	2.5125	1.3650	2.5225	1.2150
15Y	1.4200	-0.75	1.4160	1.4109	1.5469	2.5300	1.3600	2.5400	1.2150
20Y	1.3875	-0.75	1.3835	1.3815	1.5208	2.5500	1.3350	2.6500	1.2150
6*9M	-7.50	-0.25	-7.25	-7.18	-4.91	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-5.75	-0.50	-5.35	-5.68	-4.18	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-12.00	-0.25	-12.10	-12.18	-10.26	21.50	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-3.75	-0.25	-3.80	-4.30	-3.86	12.25	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-5.00	-0.25	-5.20	-6.06	-5.42	20.25	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-5.75	-0.25	-6.05	-7.29	-6.46	26.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.25	0.00	-1.40	-1.76	-1.56	8.00	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-2.00	0.00	-2.25	-2.99	-2.60	14.00	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.75	0.00	-0.85	-1.23	-1.05	6.00	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	0.25	0.25	-0.10	-0.31	-0.47	6.75	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	4.25	0.25	3.45	2.99	2.52	16.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	4.00	0.00	3.55	3.30	2.99	9.25	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.00	2.37	4.50	2.00	7.25	-0.25
10*15Y	1.25	0.00	1.25	1.46	2.46	6.75	1.25	12.50	-0.75
10*20Y	-2.00	0.00	-2.00	-1.48	-0.15	10.25	-2.00	24.75	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.438	-1.00	1.452	1.501	1.611	1.935	1.438	1.935	1.237
1.5Y	1.447	-0.80	1.456	1.504	1.611	2.113	1.447	2.113	1.232
2Y	1.450	-1.00	1.459	1.486	1.604	2.217	1.450	2.230	1.225
3Y	1.427	-0.50	1.427	1.444	1.572	2.308	1.412	2.315	1.200
4Y	1.480	-0.50	1.477	1.494	1.624	2.502	1.461	2.502	1.232
5Y	1.477	-0.80	1.473	1.481	1.609	2.592	1.440	2.602	1.217
7Y	1.549	-1.10	1.547	1.555	1.686	2.711	1.510	2.728	1.270
10Y	1.570	-1.10	1.566	1.569	1.710	2.815	1.520	2.815	1.355
20Y	1.588	-1.40	1.585	1.597	1.744	2.792	1.557	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.78	0.00
CALL	1.71	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.50	0.01	110.54	110.55	110.47
LKTB	131.54	0.11	131.64	131.71	131.45

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	10.45	0.50	9.85	5.99	5.31	10.45	-9.65	10.45	-17.75
1.5Y	3.05	0.30	2.91	-1.02	-0.33	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-2.75	0.25	-2.99	-4.67	-4.22	-0.25	-15.20	-0.25	-25.15
3Y	-4.20	-0.50	-3.51	-4.80	-4.92	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.75	-0.50	-9.99	-11.58	-11.60	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-11.20	-0.20	-10.44	-11.41	-11.16	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-18.15	0.35	-17.90	-19.13	-19.34	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.25	0.35	-16.27	-17.23	-18.73	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-20.05	0.65	-20.11	-21.58	-22.34	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-74.75	-3.00
-76.25	-2.50
-77.75	-1.75
-80.50	-1.00
-79.75	-1.00
-80.50	-2.00
-77.75	-2.25
-66.75	-2.25

CRS

USD/KRW 1177.60 (-1.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.7950	-3.50	1.4750	0.7450	1*2Y	-15.00	1.00
1.5Y	0.7150	-3.00	1.5250	1.1100	2*3Y	-6.50	0.50
2Y	0.6450	-2.50	1.5650	1.1400	2*5Y	-8.50	-0.50
3Y	0.5800	-2.00	1.6550	0.5450	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	0.5750	-2.00	1.7200	0.5500	3*5Y	-2.00	-1.00
5Y	0.5600	-3.00	1.7800	0.5550	4*5Y	-1.50	-1.00
7Y	0.5900	-3.00	1.8950	0.5900	5*7Y	3.00	0.00
10Y	0.7400	-3.00	2.0500	0.7400	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	1.8498	0.0167	1.8331	1.8574	1.8728	2.9773	1.7359	2.9773	0.4800
10Y	2.1046	0.0130	2.0916	2.1240	2.1390	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	39.98	2.67	37.31	40.04	41.78	103.03	3.47	103.03	-130.00
10Y	53.46	2.40	51.06	55.90	58.90	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	-1.50	0.00	-1.50	-2.75	-3.75	42.25	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	12.00	-0.10	12.10	10.80	9.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	25.48	-0.37	25.85	26.66	26.62	63.82	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	67	ODD Tenor	
09M	59.5/60		
01Y	54		
1.5Y			
02Y	41.5	SPRD	2y*3y -3.75
03Y			3y*4y -1.5/-1.25
04Y	36.5		4y*5y -0.75
05Y	35.75/36		
07Y	36		
10Y	40/39.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2y 64.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	79 건	-17	96	74	98	86	74	67
금 액	21,225 억원	-4,120	25,345	31,052	41,020	28,300	39,269	25,490

장중동향

국고채 금리, 장 마감 전 장외 미 금리 상승 영향에 낙폭 제한되며 국고 금리 하락 마감.

IRS, 1Y 이상 구간에서 금리 하락.

CRS, 전 구간 금리 하락.