IPS Daily Morning Brief

2019-07-24

종가 기준일 2019-07-23

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.5075	-1.25	1.5535	1.6535	1.7320	1.9125	1.5075	1.9125	1.2875
9M	1.4550	-1.25	1.4955	1.5879	1.6803	1.9125	1.4550	1.9125	1.2500
1Y	1.4125	-1.25	1.4500	1.5364	1.6367	1.9200	1.4125	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3650	-0.75	1.3975	1.4741	1.5790	2.0250	1.3650	2.0250	1.1900
2Y	1.3200	-0.50	1.3480	1.4203	1.5320	2.1150	1.3200	2.1150	1.1675
3Y	1.2950	0.25	1.3150	1.3810	1.4931	2.2225	1.2925	2.2225	1.1550
4Y	1.2850	0.50	1.3030	1.3643	1.4774	2.2900	1.2800	2.2950	1.1575
5Y	1.2800	0.75	1.2945	1.3530	1.4668	2.3350	1.2725	2.3400	1.1575
7Y	1.2825	0.75	1.2960	1.3510	1.4624	2.3825	1.2750	2.3950	1.1675
10Y	1.3250	1.00	1.3365	1.3855	1.4933	2.4475	1.3150	2.4850	1.2125
12Y	1.3450	1.00	1.3565	1.4055	1.5165	2.4875	1.3350	2.5225	1.2150
15Y	1.3400	1.00	1.3515	1.3998	1.5164	2.5075	1.3300	2.5400	1.2150
20Y	1.3100	1.00	1.3210	1.3691	1.4897	2.5300	1.3000	2.6500	1.2150
6*9M	-5.25	0.00	-5.80	-6.56	-5.17	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.25	0.00	-4.55	-5.15	-4.36	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-9.25	0.75	-10.20	-11.61	-10.47	21.50	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-2.50	0.75	-3.30	-3.93	-3.89	11.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-3.50	1.00	-4.50	-5.60	-5.46	18.50	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-4.00	1.25	-5.35	-6.73	-6.53	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.00	0.25	-1.20	-1.68	-1.57	7.50	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-1.50	0.50	-2.05	-2.80	-2.64	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.50	0.25	-0.85	-1.13	-1.07	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	0.25	0.00	0.15	-0.20	-0.44	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	4.50	0.25	4.20	3.25	2.65	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	4.25	0.25	4.05	3.45	3.09	8.00	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.00	2.33	4.50	2.00	7.00	-0.25
10*15Y	1.50	0.00	1.50	1.43	2.31	6.75	1.25	12.50	-0.75
10*20Y	-1.50	0.00	-1.55	-1.64	-0.36	10.25	-2.00	24.25	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.349	-0.80	1.372	1.463	1.580	1.935	1.349	1.935	1.237
1.5Y	1.356	-1.00	1.382	1.469	1.580	2.113	1.356	2.113	1.232
2Y	1.357	0.20	1.374	1.455	1.573	2.217	1.355	2.230	1.225
3Y	1.337	0.50	1.348	1.418	1.541	2.308	1.327	2.315	1.200
4Y	1.384	0.50	1.396	1.468	1.592	2.502	1.376	2.502	1.232
5Y	1.382	1.00	1.392	1.458	1.578	2.592	1.372	2.602	1.217
7Y	1.453	1.00	1.463	1.530	1.655	2.711	1.443	2.728	1.270
10Y	1.472	1.00	1.484	1.546	1.677	2.815	1.462	2.815	1.355
20Y	1.480	0.70	1.499	1.569	1.711	2.790	1.473	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.59	0.00
CALL	1.47	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.73	-0.02	110.76	110.79	110.73
LKTB	132.56	-0.11	132.72	132.82	132.56

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	6.35	-0.45	7.78	7.33	5.72	10.45	-9.65	10.45	-17.75
1.5Y	0.90	0.25	1.55	0.55	-0.11	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-3.70	-0.70	-2.60	-3.49	-4.13	-0.25	-15.20	-0.25	-25.15
3Y	-4.20	-0.25	-3.28	-3.68	-4.81	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-9.90	0.00	-9.32	-10.40	-11.48	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.20	-0.25	-9.75	-10.47	-11.16	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.05	-0.25	-16.74	-17.87	-19.22	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-14.70	0.00	-14.71	-16.01	-18.37	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-17.00	0.30	-17.82	-20.01	-22.10	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-65.75	-0.25
-68.50	-0.75
-71.00	-1.00
-74.00	-1.25
-73.50	-1.50
-74.50	-1.25
-72.75	-1.25
-62.00	-1.50

CRS

USD/KRW 1178.90 (+0.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.7550	-1.50	1.4750	0.7400	1*2Y	-14.50	0.00
1.5Y	0.6800	-1.50	1.5250	1.0800	2*3Y	-5.50	0.50
2Y	0.6100	-1.50	1.5650	1.1200	2*5Y	-7.50	1.00
3Y	0.5550	-1.00	1.6550	0.5100	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	0.5500	-1.00	1.7200	0.5000	3*5Y	-2.00	0.50
5Y	0.5350	-0.50	1.7800	0.4800	4*5Y	-1.50	0.50
7Y	0.5550	-0.50	1.8950	0.5000	5*7Y	2.00	0.00
10Y	0.7050	-0.50	2.0500	0.6500	5*10Y	17.00	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	1.8354	0.0127	1.8227	1.8265	1.7518	2.9773	1.7359	2.9773	0.4800
10Y	2.0806	0.0322	2.0484	2.0572	2.0236	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	47.84	1.07	46.77	46.95	37.18	103.03	3.57	103.03	-130.00
10Y	60.86	2.22	58.64	59.22	54.66	98.82	8.95	98.82	-47.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	0.50	1.50	-1.00	-1.25	-2.25	36.00	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	11.50	0.80	10.70	10.80	9.70	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	24.52	1.95	22.57	23.07	27.18	63.77	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6Y 67.25
06M			
09M	46.25 / 45.75		
01Y	41.25		
1.5Y	36.5 / 36.25		
02Y	31.75	SPRD	1*3Y -12.5
03Y	28.75 / 29		1.5*3Y -7.5
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	32.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	110 건	27	83	118	93	151	79	96
금 액	43,543 억원	4,388	39,155	47,110	30,000	57,488	21,225	25,345

장중동향

국고채 금리, 이주열 한은 총재가 2분기 성장률 낙관한 데 따른 매도가 등장하며 금리 상승.

IRS, 3Y 이상 구간에서 금리 상승하며 커브 스티프닝.
오전장은 단기 중심으로 오퍼리시, 오후장은 장기 중심으로 비디시한 모습.

CRS, 전 구간 금리 하락.