IPS Daily Morning Brief

2019-06-21

종가 기준일 2019-06-20

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6925	-0.75	1.7000	1.7396	1.8071	1.9125	1.6750	1.9900	1.2875
9M	1.6025	-1.75	1.6195	1.6821	1.7729	1.9125	1.6025	1.9375	1.2500
1Y	1.5325	-2.00	1.5570	1.6341	1.7400	1.9200	1.5325	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4500	-2.75	1.4835	1.5669	1.6898	2.0250	1.4500	2.0250	1.1900
2Y	1.3975	-3.00	1.4370	1.5231	1.6479	2.1150	1.3975	2.1150	1.1675
3Y	1.3475	-3.75	1.3925	1.4788	1.6118	2.2225	1.3475	2.2225	1.1550
4Y	1.3275	-4.50	1.3775	1.4599	1.5958	2.2950	1.3275	2.2950	1.1575
5Y	1.3150	-4.50	1.3660	1.4464	1.5869	2.3400	1.3150	2.3400	1.1575
7Y	1.3100	-4.50	1.3620	1.4386	1.5824	2.3950	1.3100	2.3950	1.1675
10Y	1.3450	-4.50	1.3965	1.4666	1.6095	2.4850	1.3450	2.4850	1.2125
12Y	1.3650	-4.50	1.4165	1.4909	1.6343	2.5225	1.3650	2.5225	1.2150
15Y	1.3600	-4.50	1.4115	1.4893	1.6375	2.5400	1.3600	2.5400	1.2150
20Y	1.3350	-4.25	1.3845	1.4598	1.6121	2.5600	1.3350	2.6500	1.2150
6*9M	-9.00	-1.00	-8.05	-5.75	-3.42	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-7.00	-0.25	-6.25	-4.80	-3.30	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-13.50	-1.00	-12.00	-11.10	-9.20	23.00	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-5.00	-0.75	-4.45	-4.44	-3.62	13.25	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-7.00	-1.50	-5.95	-6.33	-5.21	21.75	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-8.25	-1.50	-7.10	-7.68	-6.10	27.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.00	-0.75	-1.50	-1.89	-1.59	8.50	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-3.25	-0.75	-2.65	-3.24	-2.49	14.00	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.25	0.00	-1.15	-1.35	-0.90	6.00	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.50	0.00	-0.40	-0.77	-0.45	7.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	3.00	0.00	3.05	2.03	2.26	16.25	0.50	30.75	0.50
7*10Y	3.50	0.00	3.45	2.80	2.71	9.50	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.43	2.48	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	1.50	0.00	1.50	2.26	2.80	6.75	1.50	13.00	-0.75
10*20Y	-1.00	0.25	-1.20	-0.69	0.27	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.509	-2.50	1.527	1.595	1.690	1.935	1.509	1.935	1.237
1.5Y	1.504	-3.20	1.526	1.588	1.689	2.113	1.504	2.113	1.232
2Y	1.477	-3.80	1.508	1.574	1.684	2.230	1.477	2.230	1.225
3Y	1.422	-5.50	1.471	1.544	1.660	2.315	1.422	2.315	1.200
4Y	1.470	-5.20	1.517	1.590	1.712	2.502	1.470	2.502	1.232
5Y	1.452	-5.00	1.500	1.575	1.696	2.602	1.452	2.602	1.217
7Y	1.536	-4.80	1.582	1.650	1.775	2.728	1.536	2.728	1.270
10Y	1.550	-4.50	1.594	1.669	1.806	2.815	1.550	2.815	1.355
20Y	1.585	-4.50	1.636	1.711	1.839	2.792	1.585	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.80	0.00
CALL	1.75	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.63	0.18	110.56	110.68	110.54
LKTB	131.83	0.53	131.65	132.02	131.52

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	2.35	0.50	2.96	3.90	4.98	7.85	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	-5.40	0.45	-4.27	-2.06	0.09	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-7.95	0.80	-7.10	-5.09	-3.56	-0.25	-15.70	-0.25	-25.15
3Y	-7.45	1.75	-7.89	-6.54	-4.85	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-14.25	0.70	-13.97	-13.06	-11.62	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-13.70	0.50	-13.42	-12.84	-10.92	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-22.60	0.30	-22.02	-21.10	-19.30	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-20.50	0.00	-19.77	-20.24	-19.67	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-25.00	0.25	-25.13	-25.17	-22.72	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-78.25	-5.00
-76.50	-3.25
-79.75	-3.00
-79.75	-3.25
-77.25	-3.50
-76.00	-2.50
-68.50	-3.50
-55.00	-3.50

CRS

USD/KRW 11.62.1 #VALUE!

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.7500	-7.00	1.4750	0.7500	1*2Y	-15.00	1.00
1.5Y	0.6850	-6.00	1.5250	1.1650	2*3Y	-5.00	-1.00
2Y	0.6000	-6.00	1.5650	1.2350	2*5Y	-4.50	-1.00
3Y	0.5500	-7.00	1.6550	0.5500	3*4Y	0.50	-1.00
4Y	0.5550	-8.00	1.7200	0.5550	3*5Y	0.50	0.00
5Y	0.5550	-7.00	1.7800	0.5550	4*5Y	0.00	1.00
7Y	0.6250	-8.00	1.8950	0.6250	5*7Y	7.00	-1.00
10Y	0.7950	-8.00	2.0500	0.7950	5*10Y	24.00	-1.00

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	1.7837	0.0445	1.7392	1.8581	1.8789	2.9773	1.7392	2.9773	0.4800
10Y	2.0251	0.0008	2.0243	2.0572	2.0900	3.2382	2.0243	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	30.67	8.25	22.42	33.11	35.89	103.03	-15.48	103.03	-130.00
10Y	47.51	4.58	42.93	44.02	46.80	98.82	-10.51	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	-1.50	-3.75	-3.75	-3.25	42.50	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	7.30	-0.70	8.00	9.00	10.20	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	24.14	-4.37	28.51	19.91	21.11	79.07	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	69.25	ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y		SPRD	6m*1y -16.25
03Y	33.25/35.25		9m*1y -7.25
04Y	31.75		3y*4y -1.5
05Y	30		3y*10y 0.25
07Y			5y*10y 3
10Y	34.25		9y*15y 2.75
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1.5y 68.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	153 건	44	109	103	69	112	84	115
금 액	49,125 억원	12,272	36,853	57,175	12,444	32,116	28,080	39,344

장중동향

국고채 금리, 비둘기적 연준 결과에 큰 폭 하락.

IRS, 연준 금리 인하 시사에 하락. 커브 플래트닝.

CRS, 전 구간 대폭 하락.