IPS Daily Morning Brief

2019-07-05

종가 기준일 2019-07-04

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.6825	-0.25	1.6900	1.7019	1.7785	1.9125	1.6825	1.9125	1.2875
9M	1.6125	-0.50	1.6280	1.6340	1.7375	1.9125	1.6025	1.9125	1.2500
1Y	1.5525	-0.25	1.5720	1.5786	1.7008	1.9200	1.5325	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4750	-0.75	1.5075	1.5118	1.6492	2.0250	1.4500	2.0250	1.1900
2Y	1.4175	-0.75	1.4535	1.4635	1.6058	2.1150	1.3975	2.1150	1.1675
3Y	1.3700	-1.00	1.4115	1.4184	1.5678	2.2225	1.3475	2.2225	1.1550
4Y	1.3475	-1.00	1.3905	1.4006	1.5520	2.2900	1.3275	2.2950	1.1575
5Y	1.3300	-1.00	1.3770	1.3881	1.5423	2.3350	1.3150	2.3400	1.1575
7Y	1.3275	-1.00	1.3730	1.3838	1.5377	2.3950	1.3100	2.3950	1.1675
10Y	1.3600	-1.00	1.4045	1.4153	1.5663	2.4850	1.3450	2.4850	1.2125
12Y	1.3800	-1.00	1.4245	1.4363	1.5906	2.5225	1.3650	2.5225	1.2150
15Y	1.3750	-1.00	1.4195	1.4320	1.5930	2.5400	1.3600	2.5400	1.2150
20Y	1.3450	-1.00	1.3895	1.4038	1.5676	2.5600	1.3350	2.6500	1.2150
6*9M	-7.00	-0.25	-6.20	-6.79	-4.10	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-6.00	0.25	-5.60	-5.54	-3.68	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-13.50	-0.50	-11.85	-11.51	-9.50	23.00	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-4.75	-0.25	-4.20	-4.51	-3.80	12.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-7.00	-0.25	-6.30	-6.29	-5.38	20.50	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-8.75	-0.25	-7.65	-7.54	-6.35	26.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.25	0.00	-2.10	-1.78	-1.58	8.25	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-4.00	0.00	-3.45	-3.03	-2.55	14.00	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.75	0.00	-1.35	-1.25	-0.97	6.00	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.25	0.00	-0.40	-0.44	-0.46	6.75	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	3.00	0.00	2.75	2.71	2.40	16.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	3.25	0.00	3.15	3.15	2.86	9.25	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.10	2.43	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	1.50	0.00	1.50	1.68	2.67	6.75	1.50	13.00	-0.75
10*20Y	-1.50	0.00	-1.50	-1.15	0.13	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.487	-2.00	1.521	1.539	1.653	1.935	1.487	1.935	1.237
1.5Y	1.497	-1.50	1.526	1.537	1.652	2.113	1.497	2.113	1.232
2Y	1.462	-1.50	1.498	1.515	1.645	2.219	1.462	2.230	1.225
3Y	1.412	-1.40	1.449	1.475	1.617	2.315	1.412	2.315	1.200
4Y	1.462	-1.30	1.504	1.525	1.669	2.502	1.462	2.502	1.232
5Y	1.440	-1.40	1.485	1.510	1.653	2.592	1.440	2.602	1.217
7Y	1.510	-0.50	1.555	1.586	1.731	2.719	1.510	2.728	1.270
10Y	1.520	-0.20	1.566	1.599	1.758	2.815	1.520	2.815	1.355
20Y	1.557	-0.30	1.600	1.639	1.792	2.792	1.557	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.78	0.00
CALL	1.73	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.58	0.05	110.55	110.59	110.50
LKTB	132.10	0.10	132.00	132.10	131.87

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	6.55	1.75	5.10	3.99	4.81	7.85	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	-2.20	0.75	-1.83	-2.56	-0.33	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-4.45	0.75	-4.47	-5.11	-3.91	-0.25	-15.20	-0.25	-25.15
3Y	-4.20	0.40	-3.79	-5.67	-4.90	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-11.45	0.30	-11.31	-12.47	-11.66	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-11.00	0.40	-10.82	-12.21	-11.10	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-18.25	-0.50	-18.22	-20.27	-19.35	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-16.00	-0.80	-16.17	-18.36	-19.17	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-21.20	-0.70	-21.07	-23.53	-22.40	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-67.25	0.25
-65.00	0.75
-66.75	0.75
-70.50	0.50
-68.25	0.50
-66.00	0.50
-62.75	0.50
-50.00	0.50

CRS

USD/KRW 1168.60 (-2.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8800	0.00	1.4750	0.7450	1*2Y	-13.00	0.00
1.5Y	0.8250	0.00	1.5250	1.1100	2*3Y	-8.50	-0.50
2Y	0.7500	0.00	1.5650	1.1400	2*5Y	-8.00	-0.50
3Y	0.6650	-0.50	1.6550	0.5450	3*4Y	0.00	0.00
4Y	0.6650	-0.50	1.7200	0.5500	3*5Y	0.50	0.00
5Y	0.6700	-0.50	1.7800	0.5550	4*5Y	0.50	0.00
7Y	0.7000	-0.50	1.8950	0.6200	5*7Y	3.00	0.00
10Y	0.8600	-0.50	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	1.7576	0.0003	1.7573	1.7573	1.7852	2.9773	1.7359	2.9773	0.4800
10Y	1.9501	-0.0249	1.9750	1.9750	2.0267	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	29.56	1.53	28.03	25.03	25.72	103.03	-5.77	103.03	-130.00
10Y	43.01	-2.29	45.30	39.30	41.47	98.82	5.24	98.82	-47.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-5.75	-0.25	-5.50	-5.00	-4.00	42.25	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	5.80	1.30	4.50	7.50	8.40	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	19.25	-2.52	21.77	21.77	24.15	73.81	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	56		
1.5Y	47.5		
02Y	43.25	SPRD	1y*2y -13.25
03Y			1y*3y -17.25
04Y			7y*8y 1
05Y	34.75		3y*5y -3.5
07Y			7y*10y 3.25
10Y			7y*15y 4.75
12Y			8y*15y 3.75
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	95 건	-6	101	96	54	152	135	120
금 액	36,090 억원	-970	37,060	40,625	16,195	55,971	47,960	31,554

장중동향

국고채 금리, 연저점 갱신하며 하락 마감.
전일 금리 하락 되돌림 시도 있었지만, 홍남기 기재부 장관의 '폴리시 믹스' 발언 효과와 7월 기준금리 인하 기대를 상쇄하기에는 역부족.

IRS, 금리 하락. 커브 플래트닝.

CRS, 중장기 구간을 중심으로 금리 하락.