IPS Daily Morning Brief

2019-08-27

종가 기준일 2019-08-26

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3925	-0.50	1.3905	1.4044	1.5738	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3175	-0.75	1.3145	1.3356	1.5074	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.2550	-1.00	1.2520	1.2779	1.4540	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.1650	-2.50	1.1745	1.2021	1.3865	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.1000	-4.00	1.1185	1.1448	1.3342	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.0475	-4.25	1.0665	1.0973	1.2910	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.0275	-4.50	1.0465	1.0745	1.2727	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.0125	-4.75	1.0350	1.0641	1.2615	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.0000	-5.25	1.0280	1.0601	1.2582	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.0225	-5.25	1.0500	1.0836	1.2884	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.0425	-5.25	1.0700	1.1028	1.3088	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.0225	-5.25	1.0500	1.0878	1.3005	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	0.9450	-5.25	0.9725	1.0248	1.2598	2.5300	0.9125	2.5925	0.9125
6*9M	-7.50	-0.25	-7.60	-6.88	-6.64	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-6.25	-0.25	-6.25	-5.78	-5.33	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-15.50	-3.00	-13.35	-13.31	-11.99	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-5.25	-0.25	-5.20	-4.75	-4.31	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-7.25	-0.50	-7.20	-7.03	-6.15	18.25	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-8.75	-0.75	-8.35	-8.06	-7.26	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.00	-0.25	-2.00	-2.28	-1.84	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.50	-0.50	-3.15	-3.31	-2.95	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.50	-0.25	-1.15	-1.04	-1.11	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-1.25	-0.50	-0.70	-0.40	-0.34	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.00	-0.50	1.50	1.95	2.68	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.25	0.00	2.20	2.35	3.02	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.91	2.04	4.50	1.50	7.00	-0.25
10*15Y	0.00	0.00	0.00	0.41	1.22	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-7.75	0.00	-7.75	-5.89	-2.85	10.25	-8.00	24.25	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.136	-0.80	1.141	1.209	1.394	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.137	-1.50	1.143	1.196	1.390	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.145	-1.80	1.138	1.180	1.374	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.120	-3.50	1.133	1.121	1.332	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.158	-4.90	1.182	1.208	1.393	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.145	-5.70	1.178	1.207	1.385	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.181	-6.20	1.220	1.255	1.450	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.190	-6.20	1.230	1.265	1.464	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.212	-4.80	1.234	1.258	1.480	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.49	0.00
CALL	1.52	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.38	0.17	111.40	111.43	111.34
LKTB	135.77	0.73	135.97	135.97	135.65

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	11.90	-0.20	11.08	6.86	5.98	12.10	-9.65	12.10	-17.75
1.5Y	2.80	-1.00	3.11	0.61	-0.31	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-4.50	-2.20	-1.95	-3.52	-3.98	-0.25	-13.75	-0.25	-25.15
3Y	-7.25	-0.75	-6.69	-2.41	-4.10	92.30	-12.25	92.30	-19.50
4Y	-13.05	0.40	-13.55	-13.37	-12.07	-4.50	-22.95	-0.45	-30.35
5Y	-13.25	0.95	-14.34	-14.29	-12.39	-3.20	-27.25	-1.50	-27.25
7Y	-18.10	0.95	-19.22	-19.53	-19.20	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-16.75	0.95	-18.04	-18.16	-17.54	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-26.70	-0.45	-26.17	-23.30	-22.00	1.75	-29.50	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-78.00	-4.00
-80.00	-3.50
-86.00	-2.25
-88.75	-1.75
-87.25	-1.50
-87.25	-0.75
-78.50	-0.25
-63.25	-0.25

CRS

USD/KRW 1217.80 (+7.20)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.4750	-5.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-23.50	-1.25
1.5Y	0.3650	-6.00	1.3950	1.0400	2*3Y	-8.00	0.25
2Y	0.2400	-6.25	1.3750	1.0900	2*5Y	-10.00	0.75
3Y	0.1600	-6.00	1.4600	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	0.1550	-6.00	1.5300	0.0350	3*5Y	-2.00	0.50
5Y	0.1400	-5.50	1.5900	0.0150	4*5Y	-1.50	0.50
7Y	0.2150	-5.50	1.7200	0.0750	5*7Y	7.50	0.00
10Y	0.3900	-5.50	1.9000	0.2550	5*10Y	25.00	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	1.5391	0.0120	1.5271	1.6223	1.5774	2.9773	1.4885	2.9773	0.5400
10Y	1.5351	-0.0025	1.5376	1.6165	1.5910	3.2382	1.5278	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	39.41	3	36.41	49.23	42.24	103.03	18.02	103.03	-127.00
10Y	34.51	5.95	28.56	38.65	31.10	98.82	8.95	98.82	-33.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-7.75	-1.25	-6.50	-7.00	-5.50	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	4.50	-4.40	8.90	10.00	12.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	-0.40	-1.45	1.05	-0.58	1.36	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	30.75		
01Y			
1.5Y			
02Y	7.5 / 8.25 / 8.5 / 8.75 / 9.75 / 10	SPRD	6*12m -14.5
03Y	3.75		
04Y	1.5 / 1.75		
05Y	0.25 / 99.5 / 99.75		
07Y			
10Y	1 / 99.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	114 건	11	103	113	85	80	76	83
금 액	44,535 억원	2,720	41,815	35,325	29,220	24,825	26,513	36,835

장중동향

국고채 금리, 미중 무역전쟁 상황이 다시 악화하면서 금리 큰 폭 하락.

IRS, 전 구간 금리 하락. 커브 플래트닝.
단기 내 금리 인하가 없을 것이란 예상에 힘이 실리는 가운데,
무역분쟁 우려 격화로 장기 중심 금리 하락.

CRS, 전 구간 금리 하락.