IPS Daily Morning Brief

2019-09-04

종가 기준일 2019-09-03

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4025	-0.25	1.4015	1.3943	1.5411	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3425	-0.25	1.3360	1.3224	1.4731	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3025	-0.50	1.2925	1.2651	1.4194	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2400	-0.50	1.2200	1.1861	1.3507	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.1850	-1.25	1.1630	1.1265	1.2966	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.1475	-1.00	1.1195	1.0774	1.2537	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.1325	-1.25	1.1030	1.0568	1.2357	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.1175	-1.50	1.0885	1.0446	1.2248	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.1100	-1.75	1.0820	1.0389	1.2216	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.1350	-1.75	1.1040	1.0601	1.2515	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.1550	-1.75	1.1240	1.0794	1.2712	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.1375	-1.50	1.1045	1.0603	1.2613	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.0625	-1.50	1.0295	0.9863	1.2161	2.5300	0.9125	2.5650	0.9125

6*9M	-6.00	0.00	-6.55	-7.19	-6.80	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.00	-0.25	-4.35	-5.73	-5.38	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-11.75	-0.75	-12.95	-13.86	-12.28	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-3.75	0.25	-4.35	-4.91	-4.29	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-5.25	0.00	-6.00	-6.98	-6.09	18.25	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-6.75	-0.25	-7.45	-8.19	-7.19	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.50	-0.25	-1.65	-2.06	-1.80	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.00	-0.50	-3.10	-3.28	-2.90	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.50	-0.25	-1.45	-1.21	-1.10	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.75	-0.25	-0.65	-0.57	-0.32	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.75	-0.25	1.55	1.55	2.67	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.50	0.00	2.20	2.13	2.99	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.93	1.98	4.50	1.50	7.00	-0.25
10*15Y	0.25	0.25	0.05	0.01	0.98	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-7.25	0.25	-7.45	-7.39	-3.53	10.25	-8.00	24.25	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.225	0.50	1.195	1.180	1.353	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.253	0.60	1.219	1.175	1.352	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.247	-0.80	1.224	1.164	1.339	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.216	-1.40	1.195	1.105	1.297	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.273	-1.70	1.246	1.197	1.359	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.277	-2.00	1.249	1.197	1.352	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.307	-2.40	1.279	1.238	1.413	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.320	-2.50	1.289	1.248	1.426	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.307	-3.00	1.286	1.243	1.437	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.49	0.00
CALL	1.53	3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.99	0.03	110.99	111.04	110.95
LKTB	134.30	0.20	134.20	134.40	134.03

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	7.75	-1.00	9.77	8.54	6.62	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-1.30	-1.10	0.08	1.09	-0.18	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-6.20	-0.45	-6.14	-3.79	-4.24	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-6.85	0.40	-7.57	-2.76	-4.35	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-14.05	0.45	-14.28	-14.05	-12.32	-4.50	-21.70	-0.45	-30.35
5Y	-15.95	0.50	-16.05	-15.25	-12.75	-3.20	-27.25	-1.50	-27.25
7Y	-19.70	0.65	-19.68	-19.92	-19.15	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-18.50	0.75	-18.54	-18.75	-17.43	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-24.45	1.50	-25.61	-25.64	-22.13	1.75	-29.50	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-73.75	1.50
-78.00	2.00
-84.50	2.75
-89.75	2.50
-88.75	2.75
-88.25	3.00
-80.50	3.25
-65.50	3.25

CRS

USD/KRW 1215.60 (+4.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.5650	1.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-22.50	0.50
1.5Y	0.4600	1.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-9.00	0.00
2Y	0.3400	1.50	1.3750	1.0900	2*5Y	-10.50	0.00
3Y	0.2500	1.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	0.2450	1.50	1.4700	0.0350	3*5Y	-1.50	0.00
5Y	0.2350	1.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-1.00	0.00
7Y	0.3050	1.50	1.6600	0.0750	5*7Y	7.00	0.00
10Y	0.4800	1.50	1.8550	0.2550	5*10Y	24.50	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	1.4600	-0.0520	1.5120	1.5120	1.5319	2.9773	1.4600	2.9773	0.5400
10Y	1.4607	-0.0396	1.5003	1.5003	1.4970	3.2382	1.4607	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	21.30	-4.4	25.70	29.20	33.19	103.03	20.55	103.03	-117.20
10Y	14.07	-1.46	15.53	20.53	25.10	98.82	8.95	98.82	-30.00

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-5.00	-0.50	-4.50	-5.50	-6.75	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	7.30	-1.70	9.00	7.50	4.60	63.50	4.10	82.90	4.10
UST 2*10Y	0.07	1.24	-1.17	-1.17	-3.49	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	40.5	ODD Tenor	
09M			
01Y	30.25		
1.5Y	23.5 / 24		
02Y	18.5 / 18.75 / 19 / 19.75	SPRD	9*12m -4
03Y	14		3*4y -1.25
04Y	12.5 / 13.5		
05Y	11 / 11.25 / 12.25 / 12.5		
07Y			
10Y	14.5		
12Y			
15Y	13.25		
20Y			
CRS	1.5y CCS 46 2y CCS 34		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	103 건	-15	118	92	68	108	118	114
금 액	29,747 억원	-32,351	62,098	36,440	28,330	33,625	33,376	44,535

장중동향

금일 채권은 부진한 경제지표로 상승출발하여 등락을 거듭하다 강세 마감. 장마감 후 브렉시트와 미국 트레져리 급락으로 다음날 변동성 우려.

IRS도 전구간 강세로 레벨 하락했고 상대적으로 장기 하락폭을 더 키우며 커브 플랫 마감.

CRS는 전구간 상승 마감.