IPS Daily Morning Brief

2019-09-06

종가 기준일 2019-09-05

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4400	2.75	1.4115	1.3978	1.5319	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3900	3.75	1.3515	1.3276	1.4641	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3500	3.75	1.3110	1.2726	1.4108	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2850	3.50	1.2470	1.1955	1.3423	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2275	3.25	1.1930	1.1365	1.2878	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.1900	3.25	1.1540	1.0886	1.2453	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.1725	3.00	1.1390	1.0688	1.2272	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.1575	3.00	1.1245	1.0564	1.2161	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.1475	2.75	1.1175	1.0501	1.2128	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.1725	2.75	1.1420	1.0720	1.2426	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.1925	2.75	1.1620	1.0916	1.2623	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.1750	2.75	1.1435	1.0726	1.2520	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1000	2.75	1.0685	0.9970	1.2053	2.5300	0.9125	2.5650	0.9125
6*9M	-5.00	1.00	-6.00	-7.01	-6.78	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.00	0.00	-4.05	-5.50	-5.33	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-12.25	-0.50	-11.80	-13.61	-12.30	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-3.75	0.00	-3.90	-4.79	-4.25	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-5.50	-0.25	-5.40	-6.78	-6.06	18.25	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-7.00	-0.25	-6.85	-8.01	-7.17	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.75	-0.25	-1.50	-1.99	-1.80	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.25	-0.25	-2.95	-3.23	-2.91	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.50	0.00	-1.45	-1.24	-1.11	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-1.00	-0.25	-0.70	-0.62	-0.33	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.50	-0.25	1.75	1.56	2.65	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.50	0.00	2.45	2.19	2.98	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.96	1.97	4.50	1.50	7.00	-0.25
10*15Y	0.25	0.00	0.15	0.06	0.94	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-7.25	0.00	-7.35	-7.50	-3.74	10.25	-8.00	24.25	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.261	1.80	1.227	1.183	1.344	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.288	1.90	1.253	1.185	1.344	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.277	2.20	1.251	1.174	1.331	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.252	2.50	1.224	1.113	1.289	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.315	3.00	1.282	1.208	1.351	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.320	3.00	1.287	1.208	1.345	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.351	3.00	1.319	1.247	1.404	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.365	3.00	1.332	1.257	1.417	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.345	3.00	1.317	1.251	1.426	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	3.00
CALL	1.50	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.87	-0.08	110.96	111.00	110.82
LKTB	133.81	-0.32	134.21	134.24	133.54

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	8.90	1.95	8.42	9.00	6.72	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-0.30	1.60	-0.64	1.10	-0.18	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-4.95	1.05	-5.78	-3.78	-4.30	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-6.20	0.75	-7.00	-2.46	-4.39	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-14.25	0.00	-14.30	-13.96	-12.39	-4.50	-21.70	-1.25	-30.35
5Y	-16.25	0.00	-16.27	-15.20	-12.89	-3.20	-27.25	-2.20	-27.25
7Y	-20.35	-0.25	-20.13	-19.67	-19.14	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-19.25	-0.25	-19.00	-18.47	-17.44	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-24.50	-0.25	-24.87	-25.35	-22.08	1.75	-29.50	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-78.50	-2.25
-84.00	-3.00
-90.75	-2.75
-97.00	-3.25
-97.25	-3.50
-97.75	-4.50
-89.75	-4.25
-74.75	-4.25

CRS

USD/KRW 1200.20 (-8.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.5650	1.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-24.50	-1.00
1.5Y	0.4450	0.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-10.00	-0.50
2Y	0.3200	0.50	1.3750	1.0900	2*5Y	-14.00	-2.00
3Y	0.2200	0.00	1.4100	0.0450	3*4Y	-2.00	-0.50
4Y	0.2000	-0.50	1.4700	0.0350	3*5Y	-4.00	-1.50
5Y	0.1800	-1.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-2.00	-1.00
7Y	0.2500	-1.50	1.6600	0.0750	5*7Y	7.00	0.00
10Y	0.4250	-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	1.5281	0.0962	1.4319	1.4600	1.5120	2.9773	1.4319	2.9773	0.5400
10Y	1.5653	0.0963	1.4690	1.4607	1.5003	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	25.11	7.42	17.69	21.30	25.70	103.03	17.69	103.03	-117.20
10Y	20.03	6.63	13.40	14.07	15.53	98.82	8.95	98.82	-29.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-5.50	-0.50	-5.00	-5.00	-4.50	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	8.80	0.80	8.00	7.30	9.00	63.50	4.10	82.90	4.10
UST 2*10Y	3.72	0.01	3.71	0.07	-1.17	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	8y 16
06M	4 / 43.75 / 44		
09M			
01Y	35.75		
1.5Y	29		
02Y	23.25	SPRD	2*5y -07
03Y			9*20y -06
04Y			
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3y CCS 19 3y CCS 19.5 2*4y CCS -12		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	113 건	19	94	103	118	92	68	108
금 액	52,955 억원	23,885	29,070	29,747	62,098	36,440	28,330	33,625

장중동향

국고채 금리, 미·중 무역 협상이 재개 등 글로벌 불확실성 전반적 완화 영향으로 금리 상승. CD금리 급등.

IRS, 전 구간 금리 상승. CD 유통금리 급등에 단기 중심 비디쉬.

CRS, 단기구간 중심 금리 상승, 4Y 이상 구간에서 금리 하락.