

IPS Daily Morning Brief

2019-08-01

종가 기준일 2019-07-31

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4525	-2.50	1.4705	1.5863	1.6963	1.9125	1.4525	1.9125	1.2875
9M	1.4000	-2.50	1.4145	1.5224	1.6405	1.9125	1.4000	1.9125	1.2500
1Y	1.3600	-2.25	1.3740	1.4744	1.5950	1.9200	1.3600	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3025	-2.50	1.3200	1.4145	1.5359	2.0250	1.3025	2.0250	1.1900
2Y	1.2575	-2.25	1.2710	1.3618	1.4883	2.1150	1.2575	2.1150	1.1675
3Y	1.2250	-2.50	1.2415	1.3265	1.4495	2.2225	1.2250	2.2225	1.1550
4Y	1.2075	-2.25	1.2275	1.3121	1.4334	2.2900	1.2075	2.2950	1.1575
5Y	1.2000	-2.50	1.2220	1.3028	1.4229	2.3350	1.2000	2.3400	1.1575
7Y	1.2000	-2.50	1.2225	1.3026	1.4189	2.3825	1.2000	2.3950	1.1675
10Y	1.2350	-2.75	1.2615	1.3400	1.4508	2.4475	1.2350	2.4850	1.2125
12Y	1.2550	-2.75	1.2815	1.3600	1.4735	2.4875	1.2550	2.5225	1.2150
15Y	1.2500	-2.75	1.2765	1.3543	1.4720	2.5075	1.2500	2.5400	1.2150
20Y	1.2150	-2.75	1.2440	1.3228	1.4438	2.5300	1.2150	2.6500	1.2150

6*9M	-5.25	0.00	-5.60	-6.39	-5.58	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.00	0.25	-4.05	-4.80	-4.54	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-10.25	0.00	-10.30	-11.26	-10.68	21.50	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-3.25	-0.25	-2.95	-3.53	-3.88	11.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-5.00	0.00	-4.35	-4.96	-5.49	18.50	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-5.75	-0.25	-4.90	-5.90	-6.53	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.75	0.25	-1.40	-1.44	-1.61	7.50	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-2.50	0.00	-1.95	-2.38	-2.65	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.75	-0.25	-0.55	-0.94	-1.05	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	0.00	0.00	0.05	-0.01	-0.40	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	3.50	-0.25	3.95	3.73	2.78	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	3.50	-0.25	3.90	3.74	3.18	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.00	2.28	4.50	2.00	7.00	-0.25
10*15Y	1.50	0.00	1.50	1.43	2.12	6.75	1.25	12.50	-0.75
10*20Y	-2.00	0.00	-1.75	-1.73	-0.70	10.25	-2.00	24.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.314	-0.80	1.323	1.400	1.539	1.931	1.314	1.935	1.237
1.5Y	1.311	-1.10	1.320	1.404	1.538	2.113	1.311	2.113	1.232
2Y	1.300	-2.40	1.312	1.396	1.530	2.212	1.300	2.230	1.225
3Y	1.288	-1.70	1.298	1.367	1.499	2.308	1.287	2.315	1.200
4Y	1.325	-2.00	1.340	1.415	1.549	2.502	1.325	2.502	1.232
5Y	1.320	-2.00	1.335	1.408	1.536	2.592	1.320	2.602	1.217
7Y	1.374	-2.30	1.394	1.477	1.610	2.711	1.374	2.728	1.270
10Y	1.385	-2.50	1.408	1.494	1.630	2.815	1.385	2.815	1.355
20Y	1.375	-2.20	1.392	1.504	1.659	2.790	1.375	2.817	1.375

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.50	-2.00
CALL	1.56	4.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.90	0.07	110.84	110.90	110.83
LKTb	133.53	0.30	133.29	133.53	133.23

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	4.60	-1.45	5.10	7.48	5.63	10.45	-9.65	10.45	-17.75
1.5Y	-0.85	-1.40	-0.02	1.07	-0.23	3.70	-11.65	3.70	-19.10
2Y	-4.25	0.15	-4.08	-3.38	-4.18	-0.25	-15.20	-0.25	-25.15
3Y	-6.30	-0.80	-5.63	-4.10	-4.96	2.55	-12.75	4.75	-19.50
4Y	-11.75	-0.25	-11.23	-10.25	-11.55	-4.50	-25.00	1.55	-30.35
5Y	-12.00	-0.50	-11.28	-10.52	-11.32	-3.20	-27.25	3.85	-27.25
7Y	-17.40	-0.20	-17.15	-17.43	-19.12	-7.85	-34.75	-5.80	-37.65
10Y	-15.00	-0.25	-14.63	-15.38	-17.95	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-16.00	-0.55	-14.84	-18.15	-21.56	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1183.10 (+1.50)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-66.00	3.25	1Y	0.7000	1.00	1.4750	0.6900	1*2Y	-14.50	0.50
-67.75	3.50	1.5Y	0.6250	1.00	1.5250	1.0400	2*3Y	-4.50	1.00
-70.25	3.75	2Y	0.5550	1.50	1.5650	1.0900	2*5Y	-7.00	1.00
-71.50	5.00	3Y	0.5100	2.50	1.6550	0.4800	3*4Y	-0.50	0.00
-70.25	4.75	4Y	0.5050	2.50	1.7200	0.4750	3*5Y	-2.50	0.00
-71.50	5.00	5Y	0.4850	2.50	1.7800	0.4550	4*5Y	-2.00	0.00
-69.00	5.00	7Y	0.5100	2.50	1.8950	0.4800	5*7Y	2.50	0.00
-57.50	5.25	10Y	0.6600	2.50	2.0500	0.6300	5*10Y	17.50	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	1.8701	0.0162	1.8539	1.8618	1.8537	2.9773	1.7359	2.9773	0.5000
10Y	2.0146	-0.0471	2.0617	2.0661	2.0688	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	57.01	4.02	52.99	56.18	53.37	103.03	5.30	103.03	-130.00
10Y	62.96	-2.21	65.17	65.41	64.88	98.82	8.95	98.82	-47.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-2.25	-0.50	-1.75	-0.75	0.00	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	8.50	-0.10	8.60	11.20	10.00	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	14.45	-6.33	20.78	20.43	21.51	60.20	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	26.5	SPRD					2*4y -5.25		
03Y	24								
04Y									
05Y	20.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	87 건	7	80	57	64	101	113	110	
금 액	38,972 억원	8,817	30,155	20,150	20,990	39,080	41,066	43,543	

장중동향
국고채 금리, 미 FOMC 통화정책 회의 결과 발표를 하루 앞두고 금리 하락.

IRS, 단기 구간은 CD 금리 & 중장기 구간은 국채시장에 연동되며 전 구간 금리 하락.
FOMC를 앞두고 있어 적극적인 모습은 보이지 않음.

CRS, 전 구간 금리 상승.