

IPS Daily Morning Brief

2019-08-06

종가 기준일 2019-08-05

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4000	-2.25	1.4430	1.5475	1.6764	1.9125	1.4000	1.9125	1.2875
9M	1.3350	-4.00	1.3905	1.4866	1.6188	1.9125	1.3350	1.9125	1.2500
1Y	1.2800	-5.50	1.3480	1.4406	1.5723	1.9200	1.2800	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2050	-7.00	1.2870	1.3824	1.5117	2.0250	1.2050	2.0250	1.1900
2Y	1.1450	-8.00	1.2380	1.3309	1.4635	2.1150	1.1450	2.1150	1.1450
3Y	1.0950	-9.25	1.2015	1.2965	1.4242	2.2225	1.0950	2.2225	1.0950
4Y	1.0625	-9.75	1.1780	1.2813	1.4073	2.2900	1.0625	2.2950	1.0625
5Y	1.0500	-10.25	1.1700	1.2731	1.3968	2.3350	1.0500	2.3400	1.0500
7Y	1.0450	-10.75	1.1690	1.2733	1.3927	2.3825	1.0450	2.3950	1.0450
10Y	1.0675	-11.50	1.2005	1.3101	1.4246	2.4475	1.0675	2.4850	1.0675
12Y	1.0875	-11.50	1.2205	1.3301	1.4470	2.4875	1.0875	2.5225	1.0875
15Y	1.0825	-11.50	1.2155	1.3244	1.4447	2.5075	1.0825	2.5400	1.0825
20Y	1.0425	-11.50	1.1780	1.2915	1.4154	2.5300	1.0425	2.6500	1.0425

6*9M	-6.50	-1.75	-5.25	-6.09	-5.76	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-5.50	-1.50	-4.25	-4.60	-4.65	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-13.50	-2.50	-11.00	-10.98	-10.87	20.50	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-5.00	-1.25	-3.65	-3.44	-3.94	11.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-8.25	-1.75	-6.00	-4.96	-5.63	18.50	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-9.50	-2.25	-6.80	-5.78	-6.68	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-3.25	-0.50	-2.35	-1.53	-1.69	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-4.50	-1.00	-3.15	-2.34	-2.74	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.25	-0.50	-0.80	-0.81	-1.05	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.50	-0.50	-0.10	0.01	-0.40	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.75	-1.25	3.05	3.70	2.78	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.25	-0.75	3.15	3.69	3.19	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.00	2.24	4.50	2.00	7.00	-0.25
10*15Y	1.50	0.00	1.50	1.43	2.01	6.75	1.25	12.50	-0.75
10*20Y	-2.50	0.00	-2.25	-1.86	-0.92	10.25	-2.50	24.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.241	-4.70	1.298	1.370	1.517	1.928	1.241	1.935	1.237
1.5Y	1.226	-6.30	1.295	1.373	1.516	2.113	1.226	2.113	1.226
2Y	1.202	-7.00	1.285	1.366	1.507	2.212	1.202	2.230	1.202
3Y	1.169	-7.70	1.263	1.341	1.475	2.308	1.169	2.315	1.169
4Y	1.187	-9.00	1.296	1.385	1.524	2.486	1.187	2.502	1.187
5Y	1.185	-9.20	1.293	1.381	1.512	2.592	1.185	2.602	1.185
7Y	1.240	-8.90	1.348	1.448	1.584	2.711	1.240	2.728	1.240
10Y	1.247	-9.30	1.359	1.464	1.603	2.815	1.247	2.815	1.247
20Y	1.247	-8.50	1.348	1.468	1.630	2.790	1.247	2.817	1.247

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.50	0.00
CALL	1.49	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.26	0.29	111.02	111.27	111.00
LKTb	135.00	1.07	134.10	135.05	134.04

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	3.90	-0.80	5.00	7.05	5.51	10.45	-9.65	10.45	-17.75
1.5Y	-2.10	-0.70	-0.78	0.97	-0.45	3.70	-11.65	3.70	-19.10
2Y	-5.70	-1.00	-4.70	-3.54	-4.31	-0.25	-15.20	-0.25	-25.15
3Y	-7.40	-1.55	-6.17	-4.46	-5.12	2.55	-12.75	4.75	-19.50
4Y	-12.45	-0.75	-11.78	-10.42	-11.64	-4.50	-24.45	-0.40	-30.35
5Y	-13.50	-1.05	-12.34	-10.83	-11.50	-3.20	-27.25	1.55	-27.25
7Y	-19.50	-1.85	-17.88	-17.45	-19.17	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-17.95	-2.20	-15.83	-15.42	-17.88	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-20.45	-3.00	-16.96	-17.70	-21.48	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1215.30 (+17.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-76.00	-5.00	1Y	0.5200	-10.50	1.4550	0.5200	1*2Y	-18.00	-2.50		
-77.00	-5.00	1.5Y	0.4350	-12.00	1.4850	1.0400	2*3Y	-3.50	0.50		
-80.50	-5.00	2Y	0.3400	-13.00	1.5400	1.0900	2*5Y	-7.50	0.00		
-79.00	-3.25	3Y	0.3050	-12.50	1.6250	0.3050	3*4Y	-1.50	-0.50		
-77.25	-3.25	4Y	0.2900	-13.00	1.6750	0.2900	3*5Y	-4.00	-0.50		
-78.50	-2.75	5Y	0.2650	-13.00	1.7300	0.2650	4*5Y	-2.50	0.00		
-74.00	-1.25	7Y	0.3050	-12.00	1.8450	0.3050	5*7Y	4.00	1.00		
-61.25	-1.00	10Y	0.4550	-12.50	2.0000	0.4550	5*10Y	19.00	0.50		

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	1.5773	-0.1365	1.7138	1.7340	1.8701	2.9773	1.5773	2.9773	0.5000
10Y	1.7128	-0.1334	1.8462	1.8954	2.0146	3.2382	1.7128	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	37.53	-6.65	44.18	40.70	57.01	103.03	9.89	103.03	-130.00
10Y	46.58	-4.04	50.62	48.34	62.96	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	-7.75	-3.50	-4.25	-2.75	-2.25	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	4.50	-2.30	6.80	8.50	8.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	13.55	0.31	13.24	16.14	14.45	58.40	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6y 6.5						
06M									
09M	33.5								
01Y	29.5 / 29.75								
1.5Y									
02Y		SPRD							
03Y	11.5 / 11								
04Y									
05Y	9								
07Y									
10Y	10.75								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y CCS 55								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	113 건	13	100	118	87	80	57	64	
금 액	37,125 억원	5,383	31,742	39,528	38,972	30,155	20,150	20,990	

장중동향
국고채 금리, 추가 폭락 & 환율 급등 패닉 장세에 금리 사상 최저 수준으로 하락.

IRS, 전 구간 금리 크게 하락. 커브 플랫트닝.
구간에 관계없이 오퍼리시한 모습.

CRS, 전 구간 금리 하락.