

IPS Daily Morning Brief

2019-08-07

종가 기준일 2019-08-06

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3975	-0.25	1.4270	1.5330	1.6693	1.9125	1.3975	1.9125	1.2875
9M	1.3275	-0.75	1.3710	1.4724	1.6109	1.9125	1.3275	1.9125	1.2500
1Y	1.2650	-1.50	1.3245	1.4259	1.5637	1.9200	1.2650	1.9200	1.2200
1.5Y	1.1875	-1.75	1.2590	1.3673	1.5025	2.0250	1.1875	2.0250	1.1875
2Y	1.1300	-1.50	1.2080	1.3159	1.4540	2.1150	1.1300	2.1150	1.1300
3Y	1.0800	-1.50	1.1675	1.2811	1.4143	2.2225	1.0800	2.2225	1.0800
4Y	1.0525	-1.00	1.1425	1.2655	1.3971	2.2900	1.0525	2.2950	1.0525
5Y	1.0400	-1.00	1.1330	1.2576	1.3864	2.3350	1.0400	2.3400	1.0400
7Y	1.0375	-0.75	1.1315	1.2578	1.3823	2.3825	1.0375	2.3950	1.0375
10Y	1.0575	-1.00	1.1595	1.2941	1.4140	2.4475	1.0575	2.4850	1.0575
12Y	1.0750	-1.25	1.1790	1.3140	1.4363	2.4875	1.0750	2.5225	1.0750
15Y	1.0650	-1.75	1.1730	1.3081	1.4337	2.5075	1.0650	2.5400	1.0650
20Y	1.0225	-2.00	1.1340	1.2748	1.4040	2.5300	1.0225	2.6500	1.0225

6*9M	-7.00	-0.50	-5.60	-6.06	-5.84	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-6.25	-0.75	-4.65	-4.65	-4.72	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-13.50	0.00	-11.65	-11.00	-10.97	20.50	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-5.00	0.00	-4.05	-3.48	-3.98	11.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-7.75	0.50	-6.55	-5.04	-5.70	18.50	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-9.00	0.50	-7.50	-5.83	-6.77	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.75	0.50	-2.50	-1.56	-1.72	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-4.00	0.50	-3.45	-2.35	-2.79	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.25	0.00	-0.95	-0.79	-1.07	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.25	0.25	-0.15	0.01	-0.40	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.75	0.00	2.65	3.65	2.77	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.00	-0.25	2.80	3.64	3.17	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	1.75	-0.25	1.95	1.99	2.23	4.50	1.75	7.00	-0.25
10*15Y	0.75	-0.75	1.35	1.40	1.96	6.75	0.75	12.50	-0.75
10*20Y	-3.50	-1.00	-2.55	-1.94	-1.01	10.25	-3.50	24.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.239	-0.20	1.281	1.358	1.509	1.928	1.239	1.935	1.237
1.5Y	1.222	-0.40	1.275	1.360	1.508	2.113	1.222	2.113	1.222
2Y	1.195	-0.70	1.259	1.353	1.498	2.212	1.195	2.230	1.195
3Y	1.165	-0.40	1.235	1.328	1.466	2.308	1.165	2.315	1.165
4Y	1.186	-0.10	1.264	1.371	1.514	2.486	1.186	2.502	1.186
5Y	1.186	0.10	1.263	1.368	1.502	2.592	1.185	2.602	1.185
7Y	1.244	0.40	1.317	1.434	1.575	2.711	1.240	2.728	1.240
10Y	1.255	0.80	1.328	1.450	1.593	2.815	1.247	2.815	1.247
20Y	1.257	1.00	1.320	1.453	1.619	2.790	1.247	2.817	1.247

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.30	0.04	111.40	111.44	111.14
LKTb	135.00	0.00	135.49	135.60	134.51

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	2.60	-1.30	4.31	6.76	5.43	10.45	-9.65	10.45	-17.75
1.5Y	-3.45	-1.35	-1.58	0.74	-0.56	3.70	-11.65	3.70	-19.10
2Y	-6.50	-0.80	-5.12	-3.71	-4.38	-0.25	-15.20	-0.25	-25.15
3Y	-8.50	-1.10	-6.77	-4.71	-5.21	2.55	-12.75	4.75	-19.50
4Y	-13.35	-0.90	-12.15	-10.60	-11.69	-4.50	-24.45	-0.45	-30.35
5Y	-14.60	-1.10	-12.96	-11.03	-11.58	-3.20	-27.25	1.05	-27.25
7Y	-20.65	-1.15	-18.57	-17.59	-19.22	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-19.75	-1.80	-16.83	-15.60	-17.91	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-23.45	-3.00	-18.56	-17.85	-21.54	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1215.30 (0.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-79.50	-3.50	1Y	0.4700	-5.00	1.4550	0.4700	1*2Y	-17.50	0.50		
-79.75	-2.75	1.5Y	0.3900	-4.50	1.4700	1.0400	2*3Y	-3.50	0.00		
-83.50	-3.00	2Y	0.2950	-4.50	1.5250	1.0900	2*5Y	-7.00	0.50		
-82.00	-3.00	3Y	0.2600	-4.50	1.6050	0.2600	3*4Y	-1.00	0.50		
-80.25	-3.00	4Y	0.2500	-4.00	1.6600	0.2500	3*5Y	-3.50	0.50		
-81.50	-3.00	5Y	0.2250	-4.00	1.7150	0.2250	4*5Y	-2.50	0.00		
-77.75	-3.75	7Y	0.2600	-4.50	1.8300	0.2600	5*7Y	3.50	-0.50		
-64.25	-3.00	10Y	0.4150	-4.00	1.9850	0.4150	5*10Y	19.00	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	1.5971	0.0198	1.5773	1.7138	1.7340	2.9773	1.5773	2.9773	0.5000
10Y	1.7075	-0.0053	1.7128	1.8462	1.8954	3.2382	1.7075	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	40.21	2.68	37.53	44.18	40.70	103.03	9.89	103.03	-130.00
10Y	45.25	-1.33	46.58	50.62	48.34	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	-7.25	0.50	-7.75	-4.25	-2.75	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	6.00	1.50	4.50	6.80	8.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	11.04	-2.51	13.55	13.24	16.14	58.40	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y	26								
1.5Y	18.75								
02Y	11.75 / 14.25				SPRD	5*10y 01			
03Y	6.5					3*20y -07 / -7.25			
04Y	3 / 5.5					5*12y 03			
05Y	4.5					7y*12 04			
07Y	5 / 4.75					1.5*2y -06			
10Y	2.25 / 07					2*5y -9.25			
12Y									
15Y	8.75								
20Y	0								
CRS	3y CCS 25.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	148 건	35	113	100	118	87	80	57	
금 액	44,130 억원	7,005	37,125	31,742	39,528	38,972	30,155	20,150	

장중동향
 국고채 금리, 달러-원, 달러-위안 등 아시아 지역 환율 전반에 장중 상승하기도 했지만 반발 매수세와 증시 하락 등 강세 재료에 혼조세로 마감했다

IRS, 전 구간 금리 하락.
 간밤 미 국채금리 급락에 연동해 금리가 하락하며 시작했지만, 위안화 환율이 7위안 아래로 고시되면서 이를 상당부분 되돌리는 흐름이 나타남

CRS, 전 구간 금리 하락.