

IPS Daily Morning Brief

2019-08-08

종가 기준일 2019-08-07

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3900	-0.75	1.4145	1.5181	1.6621	1.9125	1.3900	1.9125	1.2875
9M	1.3175	-1.00	1.3545	1.4574	1.6029	1.9125	1.3175	1.9125	1.2500
1Y	1.2550	-1.00	1.3035	1.4104	1.5550	1.9200	1.2550	1.9200	1.2200
1.5Y	1.1725	-1.50	1.2330	1.3509	1.4930	2.0250	1.1725	2.0250	1.1725
2Y	1.1100	-2.00	1.1785	1.2993	1.4443	2.1150	1.1100	2.1150	1.1100
3Y	1.0600	-2.00	1.1345	1.2640	1.4041	2.2225	1.0600	2.2225	1.0600
4Y	1.0350	-1.75	1.1080	1.2479	1.3867	2.2900	1.0350	2.2950	1.0350
5Y	1.0225	-1.75	1.0975	1.2399	1.3758	2.3350	1.0225	2.3400	1.0225
7Y	1.0200	-1.75	1.0955	1.2400	1.3718	2.3825	1.0200	2.3950	1.0200
10Y	1.0375	-2.00	1.1200	1.2756	1.4034	2.4475	1.0375	2.4850	1.0375
12Y	1.0550	-2.00	1.1390	1.2954	1.4255	2.4875	1.0550	2.5225	1.0550
15Y	1.0350	-3.00	1.1300	1.2889	1.4224	2.5075	1.0350	2.5400	1.0350
20Y	0.9825	-4.00	1.0875	1.2545	1.3921	2.5300	0.9825	2.6500	0.9825

6*9M	-7.25	-0.25	-6.00	-6.08	-5.92	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-6.25	0.00	-5.10	-4.70	-4.79	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-14.50	-1.00	-12.50	-11.11	-11.08	20.50	-14.50	23.00	-14.50
2*3Y	-5.00	0.00	-4.40	-3.53	-4.01	11.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-7.50	0.25	-7.05	-5.14	-5.76	18.50	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-8.75	0.25	-8.10	-5.94	-6.84	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.50	0.25	-2.65	-1.61	-1.75	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.75	0.25	-3.70	-2.41	-2.83	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.25	0.00	-1.05	-0.80	-1.08	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.25	0.00	-0.20	0.01	-0.40	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.50	-0.25	2.25	3.58	2.75	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	1.75	-0.25	2.45	3.56	3.15	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	1.75	0.00	1.90	1.98	2.21	4.50	1.75	7.00	-0.25
10*15Y	-0.25	-1.00	1.00	1.33	1.90	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-5.50	-2.00	-3.25	-2.11	-1.13	10.25	-5.50	24.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.224	-1.50	1.263	1.346	1.502	1.928	1.224	1.935	1.224
1.5Y	1.185	-3.70	1.250	1.345	1.499	2.113	1.185	2.113	1.185
2Y	1.165	-3.00	1.232	1.337	1.488	2.212	1.165	2.230	1.165
3Y	1.147	-1.80	1.207	1.314	1.457	2.308	1.147	2.315	1.147
4Y	1.175	-1.10	1.234	1.356	1.504	2.486	1.175	2.502	1.175
5Y	1.177	-0.90	1.234	1.353	1.493	2.592	1.177	2.602	1.177
7Y	1.235	-0.90	1.289	1.418	1.565	2.711	1.235	2.728	1.235
10Y	1.247	-0.80	1.300	1.434	1.583	2.815	1.247	2.815	1.247
20Y	1.245	-1.20	1.294	1.436	1.609	2.790	1.245	2.817	1.245

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.49	0.00
CALL	1.48	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.33	0.03	111.33	111.39	111.28
LKTb	135.05	0.05	135.15	135.40	134.92

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	3.10	0.50	4.01	6.46	5.35	10.45	-9.65	10.45	-17.75
1.5Y	-1.25	2.20	-1.66	0.56	-0.63	3.70	-11.65	3.70	-19.10
2Y	-5.50	1.00	-5.37	-3.82	-4.42	-0.25	-15.20	-0.25	-25.15
3Y	-8.70	-0.20	-7.25	-4.97	-5.29	2.55	-12.75	4.75	-19.50
4Y	-14.00	-0.65	-12.60	-10.81	-11.75	-4.50	-24.45	-0.45	-30.35
5Y	-15.45	-0.85	-13.65	-11.32	-11.68	-3.20	-27.25	0.10	-27.25
7Y	-21.50	-0.85	-19.39	-17.80	-19.28	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-20.95	-1.20	-18.02	-15.86	-17.96	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-26.25	-2.80	-20.61	-18.18	-21.65	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1214.90 (-0.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-78.00	1.50	1Y	0.4750	0.50	1.4550	0.4700	1*2Y	-19.50	-2.00		
-78.25	1.50	1.5Y	0.3900	0.00	1.4650	1.0400	2*3Y	-3.50	0.00		
-83.00	0.50	2Y	0.2800	-1.50	1.5200	1.0900	2*5Y	-6.50	0.50		
-81.50	0.50	3Y	0.2450	-1.50	1.6000	0.2450	3*4Y	-0.50	0.50		
-79.50	0.75	4Y	0.2400	-1.00	1.6550	0.2400	3*5Y	-3.00	0.50		
-80.75	0.75	5Y	0.2150	-1.00	1.7100	0.2150	4*5Y	-2.50	0.00		
-77.00	0.75	7Y	0.2500	-1.00	1.8250	0.2500	5*7Y	3.50	0.00		
-63.25	1.00	10Y	0.4050	-1.00	1.9800	0.4050	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	1.6130	0.0159	1.5971	1.5773	1.7138	2.9773	1.5773	2.9773	0.5200
10Y	1.7336	0.0261	1.7075	1.7128	1.8462	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	44.80	4.59	40.21	37.53	44.18	103.03	10.79	103.03	-130.00
10Y	48.66	3.41	45.25	46.58	50.62	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	0.00	-7.25	-7.75	-4.25	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	8.20	2.20	6.00	4.50	6.80	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	12.06	1.02	11.04	13.55	13.24	58.40	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	17 / 2.5								
02Y		SPRD	1.5*15y -13						
03Y	6.5 / 6.75 / 06		1.5*20y -18						
04Y									
05Y	2.5								
07Y	1.75								
10Y									
12Y									
15Y									
20Y	99								
CRS	1y CCS 47								
	1y CCS 47.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	161 건	13	148	113	100	118	87	80	
금 액	45,735 억원	1,605	44,130	37,125	31,742	39,528	38,972	30,155	

장종동향
국고채 금리, 보험권에서 금리 하락.

IRS, 전 구간 금리 하락. 초장기 구간 플레트닝.
전반적으로 오퍼리시, 20Y이 0.99%에 거래되면서 초장기 구간이 눌리는 추세.

CRS, 2Y 이상 구간에서 금리 하락.