IPS Daily Morning Brief

2019-08-09

종가 기준일 2019-08-08

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3925	0.25	1.4005	1.5040	1.6551	1.9125	1.3900	1.9125	1.2875
9M	1.3200	0.25	1.3350	1.4433	1.5953	1.9125	1.3175	1.9125	1.2500
1Y	1.2575	0.25	1.2785	1.3958	1.5468	1.9200	1.2550	1.9200	1.2200
1.5Y	1.1750	0.25	1.2030	1.3354	1.4841	2.0250	1.1725	2.0250	1.1725
2Y	1.1125	0.25	1.1445	1.2836	1.4349	2.1150	1.1100	2.1150	1.1100
3Y	1.0625	0.25	1.0970	1.2479	1.3945	2.2225	1.0600	2.2225	1.0600
4Y	1.0400	0.50	1.0700	1.2314	1.3769	2.2900	1.0350	2.2950	1.0350
5Y	1.0275	0.50	1.0585	1.2233	1.3660	2.3350	1.0225	2.3400	1.0225
7Y	1.0225	0.25	1.0555	1.2234	1.3620	2.3825	1.0200	2.3950	1.0200
10Y	1.0425	0.50	1.0775	1.2584	1.3934	2.4475	1.0375	2.4850	1.0375
12Y	1.0575	0.25	1.0955	1.2779	1.4153	2.4875	1.0550	2.5225	1.0550
15Y	1.0400	0.50	1.0840	1.2709	1.4118	2.5075	1.0350	2.5400	1.0350
20Y	0.9750	-0.75	1.0360	1.2349	1.3808	2.5300	0.9750	2.6500	0.9750
6*9M	-7.25	0.00	-6.55	-6.08	-5.98	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-6.25	0.00	-5.65	-4.75	-4.85	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-14.50	0.00	-13.40	-11.21	-11.19	20.50	-14.50	23.00	-14.50
2*3Y	-5.00	0.00	-4.75	-3.58	-4.04	11.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-7.25	0.25	-7.45	-5.23	-5.80	18.50	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-8.50	0.25	-8.60	-6.04	-6.89	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.25	0.25	-2.70	-1.65	-1.76	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.50	0.25	-3.85	-2.46	-2.85	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.25	0.00	-1.15	-0.81	-1.09	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.50	-0.25	-0.30	0.01	-0.40	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.50	0.00	1.90	3.51	2.74	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.00	0.25	2.20	3.50	3.14	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	1.50	-0.25	1.80	1.95	2.19	4.50	1.50	7.00	-0.25
10*15Y	-0.25	0.00	0.65	1.25	1.84	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-6.75	-1.25	-4.15	-2.35	-1.26	10.25	-6.75	24.25	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.222	-0.20	1.243	1.334	1.494	1.928	1.222	1.935	1.222
1.5Y	1.186	0.10	1.222	1.332	1.491	2.113	1.185	2.113	1.185
2Y	1.170	0.50	1.201	1.323	1.480	2.212	1.165	2.230	1.165
3Y	1.167	2.00	1.179	1.301	1.449	2.308	1.147	2.315	1.147
4Y	1.202	2.70	1.205	1.343	1.495	2.486	1.175	2.502	1.175
5Y	1.207	3.00	1.206	1.340	1.484	2.592	1.177	2.602	1.177
7Y	1.262	2.70	1.262	1.404	1.556	2.711	1.235	2.728	1.235
10Y	1.272	2.50	1.272	1.420	1.574	2.815	1.247	2.815	1.247
20Y	1.257	1.20	1.268	1.421	1.599	2.790	1.245	2.817	1.245

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.26	-0.07	111.28	111.34	111.26
LKTB	134.80	-0.25	134.76	135.01	134.73

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	3.55	0.45	3.57	6.15	5.30	10.45	-9.65	10.45	-17.75
1.5Y	-1.10	0.15	-1.86	0.34	-0.69	3.70	-11.15	3.70	-19.10
2Y	-5.75	-0.25	-5.63	-3.96	-4.48	-0.25	-14.70	-0.25	-25.15
3Y	-10.45	-1.75	-8.18	-5.33	-5.42	2.55	-12.75	4.75	-19.50
4Y	-16.20	-2.20	-13.54	-11.14	-11.85	-4.50	-24.45	-0.45	-30.35
5Y	-17.95	-2.50	-14.79	-11.72	-11.83	-3.20	-27.25	0.05	-27.25
7Y	-23.95	-2.45	-20.65	-18.11	-19.38	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-22.95	-2.00	-19.47	-16.19	-18.04	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-28.20	-1.95	-23.16	-18.59	-21.78	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-78.25	-0.25
-77.50	0.75
-81.75	1.25
-80.25	1.25
-78.00	1.50
-78.75	2.00
-74.75	2.25
-61.25	2.00

CRS

USD/KRW 1209.20 (-5.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.4750	0.00	1.4550	0.4700	1*2Y	-18.00	1.50
1.5Y	0.4000	1.00	1.4250	1.0400	2*3Y	-3.50	0.00
2Y	0.2950	1.50	1.4850	1.0900	2*5Y	-5.50	1.00
3Y	0.2600	1.50	1.5700	0.2450	3*4Y	0.00	0.50
4Y	0.2600	2.00	1.6250	0.2400	3*5Y	-2.00	1.00
5Y	0.2400	2.50	1.6800	0.2150	4*5Y	-2.00	0.50
7Y	0.2750	2.50	1.8000	0.2500	5*7Y	3.50	0.00
10Y	0.4300	2.50	1.9600	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	1.6168	0.0038	1.6130	1.5971	1.5773	2.9773	1.5773	2.9773	0.5400
10Y	1.7196	-0.0140	1.7336	1.7075	1.7128	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	44.68	-0.12	44.80	40.21	37.53	103.03	10.79	103.03	-130.00
10Y	44.76	-3.90	48.66	45.25	46.58	98.82	8.95	98.82	-43.50

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-7.00	0.25	-7.25	-7.25	-7.75	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	10.20	2.00	8.20	6.00	4.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	10.28	-1.78	12.06	11.04	13.55	58.40	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	17		
02Y		SPRD	
03Y	5.5 / 06 / 6.25		2*5Y -8.75
04Y			15*20Y -5.75
05Y	2.25 / 2.5 / 03		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	137 건	-24	161	148	113	100	118	87
금 액	42,820 억원	-2,915	45,735	44,130	37,125	31,742	39,528	38,972

장중동향

국고채 금리, 증시 회복세에 금리 상승 마감.

IRS, 장중 오퍼우위에 금리 하락이 제한되며 금리 소폭 상승 마감.
단기 구간을 중심으로 오퍼가 강한 장세.

CRS, 대부분 구간에서 금리 상승.