

IPS Daily Morning Brief

2019-08-13

종가 기준일 2019-08-12

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4050	0.50	1.3970	1.4770	1.6413	1.9125	1.3900	1.9125	1.2875
9M	1.3350	0.75	1.3255	1.4164	1.5803	1.9125	1.3175	1.9125	1.2500
1Y	1.2775	0.75	1.2650	1.3684	1.5308	1.9200	1.2550	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2000	1.25	1.1845	1.3065	1.4667	2.0250	1.1725	2.0250	1.1725
2Y	1.1400	1.25	1.1240	1.2541	1.4170	2.1150	1.1100	2.1150	1.1100
3Y	1.0900	1.25	1.0740	1.2170	1.3759	2.2225	1.0600	2.2225	1.0600
4Y	1.0725	1.75	1.0510	1.1999	1.3582	2.2900	1.0350	2.2950	1.0350
5Y	1.0625	1.75	1.0395	1.1915	1.3471	2.3350	1.0225	2.3400	1.0225
7Y	1.0575	1.75	1.0355	1.1911	1.3433	2.3825	1.0200	2.3950	1.0200
10Y	1.0775	1.75	1.0550	1.2245	1.3743	2.4475	1.0375	2.4850	1.0375
12Y	1.0950	2.00	1.0715	1.2436	1.3958	2.4875	1.0550	2.5225	1.0550
15Y	1.0775	2.00	1.0550	1.2356	1.3914	2.5075	1.0350	2.5400	1.0350
20Y	1.0025	1.75	0.9935	1.1955	1.3587	2.5300	0.9750	2.6500	0.9750

6*9M	-7.00	0.25	-7.15	-6.06	-6.10	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-5.75	0.00	-6.05	-4.80	-4.94	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-13.75	0.50	-14.10	-11.43	-11.39	20.50	-14.50	23.00	-14.50
2*3Y	-5.00	0.00	-5.00	-3.71	-4.10	11.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-6.75	0.50	-7.30	-5.43	-5.88	18.50	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-7.75	0.50	-8.45	-6.26	-6.98	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.75	0.50	-2.30	-1.71	-1.78	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-2.75	0.50	-3.45	-2.55	-2.88	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.00	0.00	-1.15	-0.84	-1.10	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.50	0.00	-0.40	-0.04	-0.39	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.50	0.00	1.55	3.30	2.71	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.00	0.00	1.95	3.34	3.10	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	1.75	0.25	1.65	1.91	2.15	4.50	1.50	7.00	-0.25
10*15Y	0.00	0.25	0.00	1.11	1.72	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-7.50	0.00	-6.15	-2.90	-1.55	10.25	-7.50	24.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.214	-0.20	1.223	1.311	1.478	1.918	1.214	1.935	1.214
1.5Y	1.189	0.10	1.194	1.305	1.475	2.113	1.185	2.113	1.185
2Y	1.177	0.50	1.176	1.295	1.462	2.212	1.165	2.230	1.165
3Y	1.182	0.70	1.167	1.276	1.432	2.308	1.147	2.315	1.147
4Y	1.217	0.70	1.198	1.316	1.478	2.486	1.175	2.502	1.175
5Y	1.220	0.50	1.201	1.314	1.468	2.592	1.177	2.602	1.177
7Y	1.272	0.30	1.256	1.376	1.538	2.711	1.235	2.728	1.235
10Y	1.282	0.20	1.267	1.391	1.555	2.815	1.247	2.815	1.247
20Y	1.270	0.30	1.259	1.388	1.579	2.790	1.245	2.817	1.245

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.49	0.00
CALL	1.51	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.21	-0.01	111.21	111.23	111.18
LKTB	134.70	0.00	134.71	134.76	134.61

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	6.35	0.95	4.20	5.74	5.26	10.45	-9.65	10.45	-17.75
1.5Y	1.10	1.15	-0.95	0.10	-0.79	3.70	-10.60	3.70	-19.10
2Y	-3.70	0.75	-5.18	-4.07	-4.51	-0.25	-13.75	-0.25	-25.15
3Y	-9.20	0.55	-9.32	-5.95	-5.63	2.55	-12.25	4.75	-19.50
4Y	-14.45	1.05	-14.70	-11.64	-12.00	-4.50	-23.75	-0.45	-30.35
5Y	-15.75	1.25	-16.15	-12.29	-12.05	-3.20	-27.25	-1.50	-27.25
7Y	-21.45	1.45	-22.09	-18.51	-19.50	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-20.45	1.55	-21.22	-16.66	-18.11	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-26.75	1.45	-26.57	-19.29	-22.00	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1216.20 (+5.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-82.25	-2.25	1Y	0.4550	-1.50	1.4550	0.4550	1*2Y	-20.50	-0.50		
-84.00	-3.25	1.5Y	0.3600	-2.00	1.4000	1.0400	2*3Y	-4.50	0.00		
-89.00	-3.25	2Y	0.2500	-2.00	1.4400	1.0900	2*5Y	-6.50	0.00		
-88.50	-3.25	3Y	0.2050	-2.00	1.5350	0.2050	3*4Y	0.00	0.00		
-86.75	-3.75	4Y	0.2050	-2.00	1.5850	0.2050	3*5Y	-2.00	0.00		
-87.75	-3.75	5Y	0.1850	-2.00	1.6600	0.1850	4*5Y	-2.00	0.00		
-82.75	-2.75	7Y	0.2300	-1.00	1.7800	0.2300	5*7Y	4.50	1.00		
-69.25	-2.75	10Y	0.3850	-1.00	1.9500	0.3850	5*10Y	20.00	1.00		

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	1.5877	-0.0487	1.6364	1.6168	1.6130	2.9773	1.5773	2.9773	0.5400
10Y	1.6488	-0.0992	1.7480	1.7196	1.7336	3.2382	1.6488	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	41.07	-5.37	46.44	44.68	44.80	103.03	10.79	103.03	-130.00
10Y	36.68	-10.12	46.80	44.76	48.66	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	-6.25	0.50	-6.75	-7.00	-7.25	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	10.50	-0.30	10.80	10.20	8.20	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	6.11	-5.05	11.16	10.28	12.06	57.72	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	27.75								
1.5Y									
02Y		SPRD	15*20y -7.75						
03Y									
04Y									
05Y	5.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1.5y CCS 38 2y CCS 27								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	36 건	-67	103	137	161	148	113	100	
금 액	17,775 억원	-22,925	40,700	42,820	45,735	44,130	37,125	31,742	

장중동향
국고채 금리, 관망세 속에 금리 소폭 하락.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.
휴가철을 맞아 거래 건수는 많지 않음.

CRS, 전 구간 금리 하락.