

IPS Daily Morning Brief

2019-08-19

종가 기준일 2019-08-16

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3750	-2.00	1.3915	1.4339	1.6135	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.2925	-3.25	1.3190	1.3716	1.5502	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.2225	-4.00	1.2560	1.3208	1.4990	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.1350	-4.50	1.1735	1.2535	1.4325	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.0700	-4.75	1.1105	1.1989	1.3815	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.0150	-5.25	1.0600	1.1589	1.3393	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	0.9875	-5.75	1.0375	1.1395	1.3209	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	0.9775	-5.75	1.0270	1.1309	1.3094	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	0.9725	-6.00	1.0235	1.1296	1.3057	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	0.9925	-6.25	1.0445	1.1593	1.3363	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.0125	-6.25	1.0640	1.1784	1.3573	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	0.9925	-6.50	1.0460	1.1679	1.3513	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	0.9125	-7.25	0.9715	1.1191	1.3152	2.5300	0.9125	2.6125	0.9125

6*9M	-8.25	-1.25	-7.25	-6.23	-6.33	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-7.00	-0.75	-6.30	-5.09	-5.12	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-15.25	-0.75	-14.55	-12.19	-11.75	20.50	-15.25	23.00	-15.25
2*3Y	-5.50	-0.50	-5.05	-4.00	-4.21	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-8.25	-1.00	-7.30	-5.94	-6.06	18.25	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-9.25	-1.00	-8.35	-6.80	-7.20	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.75	-0.50	-2.25	-1.94	-1.85	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.75	-0.50	-3.30	-2.80	-2.99	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.00	0.00	-1.05	-0.86	-1.15	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.50	-0.25	-0.35	-0.12	-0.37	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.50	-0.50	1.75	2.84	2.69	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.00	-0.25	2.10	2.96	3.06	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	1.95	1.91	2.10	4.50	1.50	7.00	-0.25
10*15Y	0.00	-0.25	0.15	0.86	1.50	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-8.00	-1.00	-7.30	-4.01	-2.11	10.25	-8.00	24.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.150	-4.10	1.189	1.268	1.445	1.918	1.150	1.935	1.150
1.5Y	1.122	-4.90	1.165	1.255	1.440	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.092	-5.00	1.139	1.240	1.425	2.212	1.092	2.230	1.092
3Y	0.092	-105.00	0.940	1.178	1.381	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.127	-5.00	1.174	1.264	1.442	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.122	-5.50	1.173	1.263	1.432	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.163	-5.50	1.217	1.318	1.500	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.170	-5.50	1.224	1.330	1.515	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.146	-5.90	1.209	1.321	1.535	2.790	1.146	2.817	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.49	0.00
CALL	1.51	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.46	0.14	111.50	111.52	111.44
LKTb	135.95	0.62	136.11	136.24	135.94

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	7.25	0.10	6.72	5.30	5.36	10.45	-9.65	10.45	-17.75
1.5Y	1.30	0.40	0.89	-0.19	-0.77	3.70	-10.60	3.70	-19.10
2Y	-2.20	0.25	-2.81	-4.13	-4.34	-0.25	-13.75	-0.25	-25.15
3Y	92.30	99.75	12.00	-1.86	-4.14	92.30	-12.25	92.30	-19.50
4Y	-13.95	-0.75	-13.65	-12.46	-12.09	-4.50	-23.20	-0.45	-30.35
5Y	-14.45	-0.25	-14.62	-13.17	-12.27	-3.20	-27.25	-1.50	-27.25
7Y	-19.05	-0.50	-19.33	-18.87	-19.41	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-17.75	-0.75	-17.99	-17.12	-17.88	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-23.35	-1.35	-23.73	-20.14	-21.95	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1210.80 (-1.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-83.25	-1.50	1Y	0.3900	-5.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-27.00	-3.00		
-87.00	-2.00	1.5Y	0.2650	-6.50	1.4000	1.0400	2*3Y	-7.50	0.50		
-95.00	-3.75	2Y	0.1200	-8.50	1.4400	1.0900	2*5Y	-10.50	1.00		
-97.00	-2.75	3Y	0.0450	-8.00	1.5350	0.0450	3*4Y	-1.00	0.00		
-95.25	-2.25	4Y	0.0350	-8.00	1.5850	0.0350	3*5Y	-3.00	0.50		
-96.25	-1.75	5Y	0.0150	-7.50	1.6600	0.0150	4*5Y	-2.00	0.50		
-89.75	-1.50	7Y	0.0750	-7.50	1.7800	0.0750	5*7Y	6.00	0.00		
-73.75	-0.75	10Y	0.2550	-7.00	1.9500	0.2550	5*10Y	24.00	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	1.4885	-0.0133	1.5018	1.5791	1.6726	2.9773	1.4885	2.9773	0.5400
10Y	1.5597	0.0319	1.5278	1.5809	1.7043	3.2382	1.5278	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	39.65	3.67	35.98	43.71	53.26	103.03	10.79	103.03	-130.00
10Y	38.97	8.69	30.28	35.59	48.43	98.82	8.95	98.82	-41.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-7.75	-1.50	-6.25	-6.25	-6.50	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	7.80	-0.50	8.30	8.30	8.00	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	7.12	4.52	2.60	0.18	3.17	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M									
09M	29								
01Y	23								
1.5Y									
02Y	06		SPRD	1*2y -16.5					
03Y	1.25 / 1.75			5*10y 1.5					
04Y				6*12m -14.75					
05Y	96.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	5y CCS -01 3y CCS 02 / 2.5 / 03 / 04 2*3y CCS -08								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	83 건	83	0	70	128	36	103	137	
금 액	36,835 억원	36,835	0,000	15,975	40,455	17,775	40,700	42,820	

장중동향
 국고채 금리, 보험권 혼조세.
 전일 미 국채금리 급등으로 약세 출발했으나, 중국 지표 부진에 따른 강세 압력으로 변동폭 제한.

IRS, 전 구간 금리 상승.
 전일 미국 금리가 많이 오른 영향을 받으며 국채선물 흐름에 따라가는 모습.

CRS, 2Y 이하 구간 금리 상승 & 3Y 이상 구간 금리 하락.