

IPS Daily Morning Brief

2019-08-23

종가 기준일 2019-08-22

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3800	-1.50	1.3840	1.4125	1.5859	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3050	-1.50	1.3045	1.3454	1.5204	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.2425	-1.75	1.2385	1.2898	1.4678	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.1650	-3.25	1.1595	1.2170	1.4007	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.1100	-4.00	1.1005	1.1604	1.3488	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.0575	-4.25	1.0470	1.1153	1.3058	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.0375	-4.50	1.0235	1.0931	1.2871	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.0250	-5.00	1.0135	1.0836	1.2758	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.0175	-5.50	1.0080	1.0808	1.2723	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.0400	-5.50	1.0290	1.1060	1.3025	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.0600	-5.50	1.0490	1.1251	1.3231	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.0400	-5.50	1.0290	1.1116	1.3155	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	0.9625	-5.50	0.9505	1.0533	1.2765	2.5300	0.9125	2.5925	0.9125

6*9M	-7.50	0.00	-7.95	-6.71	-6.55	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-6.25	-0.25	-6.60	-5.56	-5.27	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-13.25	-2.25	-13.80	-12.94	-11.90	20.50	-15.25	23.00	-15.25
2*3Y	-5.25	-0.25	-5.35	-4.51	-4.30	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-7.25	-0.50	-7.70	-6.73	-6.16	18.25	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-8.50	-1.00	-8.70	-7.68	-7.30	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.00	-0.25	-2.35	-2.21	-1.86	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.25	-0.75	-3.35	-3.16	-3.00	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.25	-0.50	-1.00	-0.95	-1.13	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.75	-0.50	-0.55	-0.29	-0.35	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.50	-0.50	1.55	2.24	2.68	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.25	0.00	2.10	2.53	3.03	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.91	2.05	4.50	1.50	7.00	-0.25
10*15Y	0.00	0.00	0.00	0.56	1.30	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-7.75	0.00	-7.85	-5.28	-2.61	10.25	-8.00	24.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.137	-1.00	1.144	1.228	1.410	1.918	1.137	1.935	1.137
1.5Y	1.136	-2.10	1.135	1.214	1.405	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.130	-2.50	1.113	1.196	1.389	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.125	-4.20	0.915	1.138	1.346	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.180	-4.00	1.161	1.225	1.408	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.180	-4.00	1.159	1.224	1.399	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.221	-4.50	1.203	1.274	1.465	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.230	-5.00	1.212	1.285	1.479	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.240	-2.70	1.204	1.273	1.496	2.790	1.146	2.792	1.146

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.32	0.14	111.16	111.32	111.16
LKTb	135.35	0.62	134.70	135.35	134.67

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	10.55	-0.75	9.45	6.19	5.75	11.30	-9.65	11.30	-17.75
1.5Y	2.90	-1.15	2.45	0.31	-0.45	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-2.00	-1.50	-1.21	-3.52	-3.99	-0.25	-13.75	-0.25	-25.15
3Y	-6.75	-0.05	13.22	-2.28	-4.07	92.30	-12.25	92.30	-19.50
4Y	-14.25	-0.50	-13.73	-13.15	-12.06	-4.50	-22.95	-0.45	-30.35
5Y	-15.50	-1.00	-14.59	-14.02	-12.36	-3.20	-27.25	-1.50	-27.25
7Y	-20.35	-1.00	-19.48	-19.37	-19.26	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-19.00	-0.50	-18.34	-17.87	-17.64	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-27.75	-2.80	-25.35	-21.99	-21.92	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1207.40 (+4.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-74.75	3.75	1Y	0.4950	2.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-22.00	0.00		
-77.00	5.25	1.5Y	0.3950	2.00	1.3950	1.0400	2*3Y	-7.50	0.00		
-83.50	6.00	2Y	0.2750	2.00	1.3750	1.0900	2*5Y	-10.00	0.00		
-85.75	6.25	3Y	0.2000	2.00	1.4600	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00		
-84.25	6.50	4Y	0.1950	2.00	1.5300	0.0350	3*5Y	-2.50	0.00		
-85.00	7.00	5Y	0.1750	2.00	1.5950	0.0150	4*5Y	-2.00	0.00		
-76.75	7.50	7Y	0.2500	2.00	1.7400	0.0750	5*7Y	7.50	0.00		
-61.50	7.00	10Y	0.4250	1.50	1.9250	0.2550	5*10Y	25.00	-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	1.6223	0.0449	1.5774	1.5082	1.5493	2.9773	1.4885	2.9773	0.5400
10Y	1.6165	0.0255	1.5910	1.5546	1.6105	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	49.23	6.99	42.24	41.12	46.03	103.03	17.94	103.03	-130.00
10Y	38.65	7.55	31.10	35.46	42.85	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	-7.00	-1.50	-5.50	-7.50	-8.00	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	10.00	-2.50	12.50	10.30	9.30	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	-0.58	-1.94	1.36	4.64	6.12	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	24.75 / 24.5 / 24.25								
1.5Y									
02Y		SPRD	2*5y -08						
03Y	7 / 7.5		1.5*4y -12.75						
04Y	05월 04일		4*5y -01						
05Y	6 / 4.5 / 4.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	113 건	28	85	80	76	83	0	70	
금 액	35,325 억원	6,105	29,220	24,825	26,513	36,835	0,000	15,975	

장중동향
국고채 금리, 전일 약세 되돌림 시도와 이주열 한은총재의 성장률 관련 발언으로 금리 하락.

IRS, 전 구간 금리 하락. 커브 플랫닝.
장중 현물 변동성이 컸던 탓에 상대적으로 거래가 적은 조용한 흐름.

CRS, 전 구간 금리 상승.