

IPS Daily Morning Brief

2019-08-26

종가 기준일 2019-08-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3975	1.75	1.3885	1.4086	1.5798	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3250	2.00	1.3110	1.3409	1.5138	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.2650	2.25	1.2470	1.2843	1.4609	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.1900	2.50	1.1705	1.2104	1.3938	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.1400	3.00	1.1145	1.1538	1.3418	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.0900	3.25	1.0620	1.1075	1.2987	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.0725	3.50	1.0405	1.0850	1.2803	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.0600	3.50	1.0300	1.0751	1.2691	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.0525	3.50	1.0240	1.0719	1.2658	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.0750	3.50	1.0455	1.0961	1.2960	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.0950	3.50	1.0655	1.1153	1.3165	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.0750	3.50	1.0455	1.1010	1.3086	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	0.9975	3.50	0.9675	1.0403	1.2687	2.5300	0.9125	2.5925	0.9125

6*9M	-7.25	0.25	-7.75	-6.78	-6.59	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-6.00	0.25	-6.40	-5.66	-5.30	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-12.50	0.75	-13.25	-13.05	-11.91	20.50	-15.25	23.00	-15.25
2*3Y	-5.00	0.25	-5.25	-4.63	-4.30	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-6.75	0.50	-7.40	-6.88	-6.15	18.25	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-8.00	0.50	-8.45	-7.86	-7.26	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.75	0.25	-2.15	-2.25	-1.84	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.00	0.25	-3.20	-3.24	-2.96	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.25	0.00	-1.05	-0.99	-1.12	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.75	0.00	-0.60	-0.32	-0.33	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.50	0.00	1.55	2.10	2.69	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.25	0.00	2.15	2.43	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	0.49	1.25	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-7.75	0.00	-7.80	-5.59	-2.73	10.25	-8.00	24.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.144	0.70	1.143	1.219	1.402	1.918	1.137	1.935	1.137
1.5Y	1.152	1.60	1.141	1.205	1.398	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.163	3.30	1.127	1.188	1.381	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.155	3.00	1.127	1.131	1.340	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.207	2.70	1.177	1.218	1.401	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.202	2.20	1.175	1.217	1.393	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.243	2.20	1.219	1.266	1.458	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.252	2.20	1.229	1.276	1.472	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.260	2.00	1.227	1.266	1.488	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.49	0.00
CALL	1.53	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.21	-0.11	111.31	111.31	111.13
LKTb	135.04	-0.31	135.34	135.38	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	12.10	1.55	10.42	6.56	5.85	12.10	-9.65	12.10	-17.75
1.5Y	3.80	0.90	2.95	0.50	-0.38	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-2.30	-0.30	-1.23	-3.40	-3.97	-0.25	-13.75	-0.25	-25.15
3Y	-6.50	0.25	-6.54	-2.32	-4.08	92.30	-12.25	92.30	-19.50
4Y	-13.45	0.80	-13.63	-13.27	-12.06	-4.50	-22.95	-0.45	-30.35
5Y	-14.20	1.30	-14.54	-14.17	-12.38	-3.20	-27.25	-1.50	-27.25
7Y	-19.05	1.30	-19.48	-19.44	-19.23	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-17.70	1.30	-18.33	-18.02	-17.60	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-26.25	1.50	-25.93	-22.59	-21.96	1.75	-29.50	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1210.60 (+3.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-74.00	0.75	1Y	0.5250	3.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-22.25	-0.25		
-76.50	0.50	1.5Y	0.4250	3.00	1.3950	1.0400	2*3Y	-8.25	-0.75		
-83.75	-0.25	2Y	0.3025	2.75	1.3750	1.0900	2*5Y	-10.75	-0.75		
-87.00	-1.25	3Y	0.2200	2.00	1.4600	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00		
-85.75	-1.50	4Y	0.2150	2.00	1.5300	0.0350	3*5Y	-2.50	0.00		
-86.50	-1.50	5Y	0.1950	2.00	1.5950	0.0150	4*5Y	-2.00	0.00		
-78.25	-1.50	7Y	0.2700	2.00	1.7400	0.0750	5*7Y	7.50	0.00		
-63.00	-1.50	10Y	0.4450	2.00	1.9250	0.2550	5*10Y	25.00	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	1.5271	-0.0952	1.6223	1.5774	1.5082	2.9773	1.4885	2.9773	0.5400
10Y	1.5376	-0.0789	1.6165	1.5910	1.5546	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	36.41	-12.82	49.23	42.24	41.12	103.03	18.02	103.03	-130.00
10Y	28.56	-10.09	38.65	31.10	35.46	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	-6.50	0.50	-7.00	-5.50	-7.50	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	8.90	-1.10	10.00	12.50	10.30	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	1.05	1.63	-0.58	1.36	4.64	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	9y 07 / 06 / 6.25						
06M			6y 6.5						
09M	31.75								
01Y	26.5								
1.5Y									
02Y	13 / 14 / 14.5	SPRD	7*12y 4.25						
03Y	7.75 / 8.75 / 10.25 / 9.5		9*10y 01						
04Y	01월 07일		3*5y -2.75						
05Y	7								
07Y									
10Y	8.5								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	103 건	-10	113	85	80	76	83	0	
금 액	41,815 억원	6,490	35,325	29,220	24,825	26,513	36,835	0,000	

장중동향
국고채 금리, 간밤 미 금리 상승 & 홍남기 경제부총리 적자국채 발언 영향으로 금리 상승.

IRS, 전 구간 금리 상승.
장중 현물 변동성이 확대되면서 상대적으로 조용한 장세.

CRS, 금리 상승.