IPS Daily Morning Brief

2019-08-28

종가 기준일 2019-08-27

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4025	1.00	1.3935	1.4006	1.5682	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3350	1.75	1.3205	1.3311	1.5015	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.2875	3.25	1.2620	1.2731	1.4480	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2025	3.75	1.1840	1.1959	1.3801	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.1400	4.00	1.1280	1.1378	1.3273	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.0925	4.50	1.0775	1.0894	1.2842	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.0725	4.50	1.0585	1.0666	1.2658	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.0575	4.50	1.0460	1.0558	1.2547	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.0475	4.75	1.0380	1.0513	1.2513	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.0700	4.75	1.0605	1.0740	1.2815	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.0900	4.75	1.0805	1.0931	1.3018	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.0700	4.75	1.0605	1.0774	1.2933	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	0.9950	5.00	0.9835	1.0124	1.2518	2.5300	0.9125	2.5650	0.9125

6*9M	-6.75	0.75	-7.30	-6.95	-6.67	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.75	1.50	-5.85	-5.80	-5.35	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-14.75	0.75	-13.40	-13.54	-12.07	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-4.75	0.50	-5.05	-4.84	-4.32	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-6.75	0.50	-6.95	-7.11	-6.15	18.25	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-8.25	0.50	-8.20	-8.20	-7.26	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.00	0.00	-1.90	-2.28	-1.84	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.50	0.00	-3.15	-3.36	-2.95	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.50	0.00	-1.25	-1.09	-1.11	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-1.00	0.25	-0.80	-0.45	-0.34	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.25	0.25	1.45	1.83	2.68	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.25	0.00	2.25	2.28	3.02	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.91	2.03	4.50	1.50	7.00	-0.25
10*15Y	0.00	0.00	0.00	0.34	1.18	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-7.50	0.25	-7.70	-6.16	-2.97	10.25	-8.00	24.25	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.165	2.90	1.146	1.201	1.387	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.184	4.70	1.153	1.189	1.383	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.187	4.20	1.156	1.173	1.367	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.177	5.70	1.149	1.115	1.326	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.216	5.80	1.196	1.202	1.387	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.210	6.50	1.191	1.201	1.379	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.243	6.20	1.231	1.248	1.443	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.250	6.00	1.240	1.257	1.457	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.265	5.30	1.249	1.251	1.472	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.49	0.00
CALL	1.53	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.18	-0.20	111.33	111.35	111.11
LKTB	135.08	-0.69	135.59	135.63	134.86

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	12.25	0.35	11.62	7.17	6.13	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	1.85	-0.95	3.08	0.68	-0.26	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-4.70	-0.20	-2.80	-3.54	-3.98	-0.25	-13.75	-0.25	-25.15
3Y	-8.45	-1.20	-7.13	-2.56	-4.13	92.30	-12.25	92.30	-19.50
4Y	-14.35	-1.30	-13.77	-13.51	-12.10	-4.50	-22.95	-0.45	-30.35
5Y	-15.25	-2.00	-14.54	-14.48	-12.43	-3.20	-27.25	-1.50	-27.25
7Y	-19.55	-1.45	-19.28	-19.65	-19.18	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-18.00	-1.25	-17.99	-18.32	-17.50	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-27.00	-0.30	-26.53	-23.87	-22.04	1.75	-29.50	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-79.75	-1.75
-82.25	-2.25
-88.00	-2.00
-91.75	-3.00
-90.25	-3.00
-90.25	-3.00
-81.75	-3.25
-66.50	-3.25

CRS

USD/KRW 1211.20 (-6.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.4900	1.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-23.00	0.50
1.5Y	0.3800	1.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-8.50	-0.50
2Y	0.2600	2.00	1.3750	1.0900	2*5Y	-10.50	-0.50
3Y	0.1750	1.50	1.4600	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	0.1700	1.50	1.5300	0.0350	3*5Y	-2.00	0.00
5Y	0.1550	1.50	1.5900	0.0150	4*5Y	-1.50	0.00
7Y	0.2300	1.50	1.7200	0.0750	5*7Y	7.50	0.00
10Y	0.4050	1.50	1.9000	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	1.5182	-0.0209	1.5391	1.5271	1.6223	2.9773	1.4885	2.9773	0.5400
10Y	1.4719	-0.0632	1.5351	1.5376	1.6165	3.2382	1.4719	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	33.12	-6.29	39.41	36.41	49.23	103.03	18.02	103.03	-126.00
10Y	22.19	-12.32	34.51	28.56	38.65	98.82	8.95	98.82	-33.00

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-7.00	0.75	-7.75	-6.50	-7.00	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	6.30	1.80	4.50	8.90	10.00	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	-4.63	-4.23	-0.40	1.05	-0.58	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			8y 3.75
06M	39.75	ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	11.5 / 12.25 / 12.5	SPRD	3*10y -02
03Y	27.5 / 7.5 / 9		10*20y -7.5
04Y	5.25 / 7.25		6*12m -12.25 /-12
05Y	4		5*10y 1.25
07Y			12*20y -9.5
10Y	6.5		6*8y 0.5
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	118 건	4	114	103	113	85	80	76
금 액	33,376 억원	-11,159	44,535	41,815	35,325	29,220	24,825	26,513

장중동향

국고채 금리, 갑작스런 외인 단기채 매도에 금리 급등.

IRS, 전 구간 금리 상승.
외인의 현물채권 대거 매도에 국채선물 낙폭이 확대되며 연동.

CRS, 전 구간 금리 상승.