IPS Daily Morning Brief

2019-08-29

종가 기준일 2019-08-28

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4050	0.25	1.3955	1.3983	1.5628	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3375	0.25	1.3240	1.3280	1.4958	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.2900	0.25	1.2680	1.2696	1.4423	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2050	0.25	1.1855	1.1910	1.3740	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.1400	0.00	1.1260	1.1319	1.3209	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.0900	-0.25	1.0755	1.0826	1.2777	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.0700	-0.25	1.0560	1.0598	1.2593	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.0550	-0.25	1.0420	1.0485	1.2483	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.0450	-0.25	1.0325	1.0435	1.2450	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.0625	-0.75	1.0540	1.0654	1.2750	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.0825	-0.75	1.0740	1.0845	1.2952	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.0625	-0.75	1.0540	1.0680	1.2864	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	0.9875	-0.75	0.9775	1.0010	1.2442	2.5300	0.9125	2.5650	0.9125
6*9M	-6.75	0.00	-7.15	-7.03	-6.70	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.75	0.00	-5.60	-5.84	-5.36	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-15.00	-0.25	-14.20	-13.78	-12.14	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-5.00	-0.25	-5.05	-4.93	-4.32	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-7.00	-0.25	-7.00	-7.21	-6.15	18.25	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-8.50	-0.25	-8.40	-8.34	-7.26	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-2.00	0.00	-1.95	-2.29	-1.83	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.50	0.00	-3.35	-3.41	-2.94	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.50	0.00	-1.40	-1.13	-1.10	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-1.00	0.00	-0.95	-0.50	-0.33	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	0.75	-0.50	1.20	1.69	2.68	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	1.75	-0.50	2.15	2.19	3.01	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.91	2.02	4.50	1.50	7.00	-0.25
10*15Y	0.00	0.00	0.00	0.26	1.14	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-7.50	0.00	-7.65	-6.44	-3.09	10.25	-8.00	24.25	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.168	0.30	1.150	1.194	1.379	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.190	0.60	1.160	1.183	1.376	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.200	1.30	1.165	1.168	1.361	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.175	-0.20	1.150	1.109	1.319	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.212	-0.40	1.195	1.196	1.381	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.210	0.00	1.189	1.195	1.373	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.235	-0.80	1.225	1.241	1.437	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.241	-0.90	1.233	1.250	1.450	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.250	-1.50	1.245	1.245	1.465	2.790	1.146	2.792	1.146

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.20	0.02	111.22	111.24	111.02
LKTB	135.23	0.15	135.31	135.43	134.68

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	12.20	-0.05	11.80	7.55	6.28	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	1.50	-0.35	2.57	0.80	-0.21	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-6.00	-1.30	-3.90	-3.62	-4.02	-0.25	-13.75	-0.25	-25.15
3Y	-8.50	-0.05	-7.49	-2.67	-4.18	92.30	-12.25	92.30	-19.50
4Y	-14.20	0.15	-13.86	-13.64	-12.13	-4.50	-22.95	-0.45	-30.35
5Y	-15.50	-0.25	-14.74	-14.65	-12.48	-3.20	-27.25	-1.50	-27.25
7Y	-19.00	0.55	-19.21	-19.73	-19.17	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-17.85	0.15	-17.86	-18.46	-17.46	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-26.25	0.75	-26.79	-24.39	-22.07	1.75	-29.50	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-78.00	1.75
-80.50	1.75
-86.00	2.00
-88.50	3.25
-87.00	3.25
-87.50	2.75
-79.50	2.25
-63.75	2.75

CRS

USD/KRW 1213.90 (+2.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.5100	2.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-23.00	0.00
1.5Y	0.4000	2.00	1.3950	1.0400	2*3Y	-7.50	1.00
2Y	0.2800	2.00	1.3750	1.0900	2*5Y	-10.00	0.50
3Y	0.2050	3.00	1.4600	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	0.2000	3.00	1.5300	0.0350	3*5Y	-2.50	-0.50
5Y	0.1800	2.50	1.5900	0.0150	4*5Y	-2.00	-0.50
7Y	0.2500	2.00	1.7200	0.0750	5*7Y	7.00	-0.50
10Y	0.4250	2.00	1.9000	0.2550	5*10Y	24.50	-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	1.5040	-0.0142	1.5182	1.5391	1.5271	2.9773	1.4885	2.9773	0.5400
10Y	1.4811	0.0092	1.4719	1.5351	1.5376	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	30.40	-2.72	33.12	39.41	36.41	103.03	18.55	103.03	-126.00
10Y	24.01	1.82	22.19	34.51	28.56	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	-7.75	-0.75	-7.00	-7.75	-6.50	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	4.10	-2.20	6.30	4.50	8.90	63.50	4.10	82.90	4.10
UST 2*10Y	-2.29	2.34	-4.63	-0.40	1.05	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	36		
01Y	31.5		
1.5Y	22.5 / 23		
02Y	14 / 14.5	SPRD	
03Y			
04Y			
05Y	5.5		
07Y	7.25 / 06		
10Y	5.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3y CCS 16 2*3y CCS -7.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	108 건	-10	118	114	103	113	85	80
금 액	33,625 억원	249	33,376	44,535	41,815	35,325	29,220	24,825

장중동향

국고채 금리, 대부분 구간에서 금리 소폭 상승.
전일 외인 채권 매도에 금통위를 앞둔 부담이 겹쳐 투자심리 위축

IRS, 국채선물 흐름이 연동하며 3Y 이상 구간에서 금리 하락. 커브 플래트닝.
2Y 아래 구간은 증권사 비드가 우위를 보이며 소폭 상승.

CRS, 전 구간 금리 상승.