

IPS Daily Morning Brief

2019-08-30

종가 기준일 2019-08-29

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3975	-0.75	1.3990	1.3950	1.5574	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3275	-1.00	1.3285	1.3235	1.4900	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.2800	-1.00	1.2755	1.2645	1.4363	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.1950	-1.00	1.1915	1.1845	1.3678	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.1325	-0.75	1.1305	1.1244	1.3143	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.0850	-0.50	1.0810	1.0744	1.2711	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.0650	-0.50	1.0615	1.0515	1.2528	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.0500	-0.50	1.0470	1.0399	1.2418	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.0450	0.00	1.0380	1.0346	1.2386	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.0650	0.25	1.0590	1.0559	1.2686	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.0850	0.25	1.0790	1.0750	1.2887	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.0650	0.25	1.0590	1.0578	1.2796	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	0.9900	0.25	0.9830	0.9889	1.2366	2.5300	0.9125	2.5650	0.9125

6*9M	-7.00	-0.25	-7.05	-7.15	-6.73	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.75	0.00	-5.30	-5.90	-5.37	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-14.75	0.25	-14.50	-14.01	-12.20	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-4.75	0.25	-4.95	-5.00	-4.32	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-6.75	0.25	-6.90	-7.29	-6.15	18.25	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-8.25	0.25	-8.35	-8.45	-7.25	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	-3.40	-3.45	-2.93	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.50	0.00	-1.45	-1.16	-1.10	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.50	0.50	-0.90	-0.52	-0.32	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.50	0.75	1.20	1.60	2.68	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.00	0.25	2.10	2.13	3.00	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.91	2.00	4.50	1.50	7.00	-0.25
10*15Y	0.00	0.00	0.00	0.19	1.10	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-7.50	0.00	-7.60	-6.70	-3.20	10.25	-8.00	24.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.176	0.80	1.158	1.187	1.372	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.196	0.60	1.172	1.177	1.370	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.200	0.00	1.179	1.162	1.355	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.160	-1.50	1.157	1.102	1.313	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.207	-0.50	1.200	1.189	1.374	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.209	-0.10	1.195	1.188	1.367	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.237	0.20	1.228	1.233	1.430	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.246	0.50	1.236	1.242	1.443	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.252	0.20	1.248	1.238	1.458	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	111.21	0.01	111.13	111.26	111.12
LKTb	135.13	-0.10	134.95	135.25	134.85

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	10.40	-1.80	11.77	7.79	6.40	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-0.10	-1.60	1.97	0.80	-0.20	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-6.75	-0.75	-4.85	-3.74	-4.07	-0.25	-13.75	-0.25	-25.15
3Y	-7.50	1.00	-7.64	-2.75	-4.20	92.30	-12.25	92.30	-19.50
4Y	-14.20	0.00	-13.85	-13.77	-12.16	-4.50	-22.80	-0.45	-30.35
5Y	-15.90	-0.40	-14.82	-14.83	-12.54	-3.20	-27.25	-1.50	-27.25
7Y	-19.20	-0.20	-18.98	-19.80	-19.16	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-18.10	-0.25	-17.68	-18.58	-17.43	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-26.20	0.05	-26.48	-24.92	-22.10	1.75	-29.50	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1216.40 (+2.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-78.00	0.00	1Y	0.5000	-1.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-23.00	0.00		
-80.50	0.00	1.5Y	0.3900	-1.00	1.3950	1.0400	2*3Y	-8.00	-0.50		
-86.25	-0.25	2Y	0.2700	-1.00	1.3750	1.0900	2*5Y	-10.00	0.00		
-89.50	-1.00	3Y	0.1900	-1.50	1.4350	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00		
-88.00	-1.00	4Y	0.1850	-1.50	1.5000	0.0350	3*5Y	-2.00	0.50		
-88.00	-0.50	5Y	0.1700	-1.00	1.5650	0.0150	4*5Y	-1.50	0.50		
-80.50	-1.00	7Y	0.2400	-1.00	1.6950	0.0750	5*7Y	7.00	0.00		
-65.00	-1.25	10Y	0.4150	-1.00	1.8750	0.2550	5*10Y	24.50	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	1.5319	0.0279	1.5040	1.5182	1.5391	2.9773	1.4885	2.9773	0.5400
10Y	1.4970	0.0159	1.4811	1.4719	1.5351	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	33.19	2.79	30.40	33.12	39.41	103.03	20.55	103.03	-126.00
10Y	25.10	1.09	24.01	22.19	34.51	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	-6.75	1.00	-7.75	-7.00	-7.75	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	4.60	0.50	4.10	6.30	4.50	63.50	4.10	82.90	4.10
UST 2*10Y	-3.49	-1.20	-2.29	-4.63	-0.40	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M	39.75								
09M									
01Y	28								
1.5Y	19.5								
02Y	13.5		6*12m -11.75						
03Y	13.5 / 13								
04Y	01월 06일								
05Y	5.25								
07Y									
10Y	6.75								
12Y		SPRD							
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	68 건	-40	108	118	114	103	113	85	
금 액	28,330 억원	-5,295	33,625	33,376	44,535	41,815	35,325	29,220	

장중동향
국고채 금리, 금통위를 하루 앞두고 보험권 혼조세.

IRS, 국채선물 흐름에 연동되며 금리 혼조 마감. 커브 스티프닝.
5Y이하 구간에서 금리 하락했으며, 단기구간은 오히려 우위.

CRS, 전 구간 금리 하락.