IPS Daily Morning Brief

2019-08-22

종가 기준일 2019-08-21

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3950	0.75	1.3870	1.4170	1.5929	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3200	1.50	1.3085	1.3506	1.5278	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.2600	2.25	1.2425	1.2961	1.4755	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.1975	4.25	1.1625	1.2246	1.4086	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.1500	5.75	1.1020	1.1681	1.3569	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.1000	6.25	1.0490	1.1241	1.3140	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.0825	7.00	1.0250	1.1026	1.2954	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.0750	7.25	1.0155	1.0935	1.2840	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.0725	7.50	1.0110	1.0910	1.2805	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.0950	7.75	1.0320	1.1173	1.3108	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.1150	7.75	1.0520	1.1364	1.3314	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.0950	7.75	1.0325	1.1236	1.3241	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.0175	7.75	0.9550	1.0676	1.2859	2.5300	0.9125	2.5925	0.9125
6*9M	-7.50	0.75	-7.85	-6.64	-6.50	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-6.00	0.75	-6.60	-5.45	-5.23	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-11.00	3.50	-14.05	-12.80	-11.86	20.50	-15.25	23.00	-15.25
2*3Y	-5.00	0.50	-5.30	-4.40	-4.28	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-6.75	1.25	-7.70	-6.55	-6.15	18.25	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-7.50	1.50	-8.65	-7.46	-7.29	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.75	0.75	-2.40	-2.15	-1.87	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-2.50	1.00	-3.35	-3.06	-3.00	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.75	0.25	-0.95	-0.91	-1.14	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.25	0.25	-0.45	-0.25	-0.35	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	2.00	0.50	1.65	2.38	2.68	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.25	0.25	2.10	2.63	3.03	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.91	2.06	4.50	1.50	7.00	-0.25
10*15Y	0.00	0.00	0.05	0.64	1.34	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-7.75	0.00	-7.70	-4.96	-2.48	10.25	-8.00	24.25	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.147	0.50	1.155	1.237	1.419	1.918	1.142	1.935	1.142
1.5Y	1.157	2.20	1.142	1.223	1.414	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.155	5.80	1.115	1.205	1.397	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.167	6.70	0.918	1.146	1.355	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.220	7.50	1.160	1.232	1.416	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.220	7.50	1.159	1.231	1.407	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.266	7.60	1.202	1.283	1.473	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.280	8.00	1.211	1.294	1.487	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.267	7.50	1.197	1.282	1.505	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.49	0.00
CALL	1.51	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.18	-0.21	111.45	111.45	111.18
LKTB	134.73	-0.89	135.87	135.87	134.66

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	11.30	1.75	8.77	5.88	5.64	11.30	-9.65	11.30	-17.75
1.5Y	4.05	2.05	2.05	0.15	-0.53	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-0.50	-0.05	-1.30	-3.67	-4.05	-0.25	-13.75	-0.25	-25.15
3Y	-6.70	-0.45	13.08	-2.20	-4.08	92.30	-12.25	92.30	-19.50
4Y	-13.75	-0.50	-13.52	-12.98	-12.05	-4.50	-22.95	-0.45	-30.35
5Y	-14.50	-0.25	-14.33	-13.79	-12.32	-3.20	-27.25	-1.50	-27.25
7Y	-19.35	-0.10	-19.12	-19.21	-19.27	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-18.50	-0.25	-17.94	-17.66	-17.67	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-24.95	0.25	-24.20	-21.40	-21.87	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-78.50	0.75
-82.25	0.25
-89.50	-0.25
-92.00	-0.75
-90.75	-1.50
-92.00	-1.75
-84.25	-0.50
-68.50	-0.75

CRS

USD/KRW 1202.50 (-5.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.4750	3.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-22.00	2.50
1.5Y	0.3750	4.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-7.50	0.00
2Y	0.2550	5.50	1.3750	1.0900	2*5Y	-10.00	0.00
3Y	0.1800	5.50	1.4600	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	0.1750	5.50	1.5300	0.0350	3*5Y	-2.50	0.00
5Y	0.1550	5.50	1.5950	0.0150	4*5Y	-2.00	0.00
7Y	0.2300	7.00	1.7400	0.0750	5*7Y	7.50	1.50
10Y	0.4100	7.00	1.9250	0.2550	5*10Y	25.50	1.50

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	1.5774	0.0692	1.5082	1.5493	1.4885	2.9773	1.4885	2.9773	0.5400
10Y	1.5910	0.0364	1.5546	1.6105	1.5597	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	42.24	1.12	41.12	46.03	39.65	103.03	10.79	103.03	-130.00
10Y	31.10	-4.36	35.46	42.85	38.97	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	-5.50	2.00	-7.50	-8.00	-7.75	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	12.50	2.20	10.30	9.30	7.80	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	1.36	-3.28	4.64	6.12	7.12	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	23		
1.5Y	14.25		
02Y	7.75 / 10.25	SPRD	6*12m -14.75
03Y			6m*1.5y -22
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	9.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	85 건	5	80	76	83	0	70	128
금 액	29,220 억원	4,395	24,825	26,513	36,835	0,000	15,975	40,455

장중동향

국고채 금리, MBS 미매각·FOMC 의사록 경계 영향에 금리 급등.

레벨 부담 지속하는 가운데 제2안심전환 대출 발행 물량 경계로 인한 MBS 미매각 소식과 FOMC 의사록 공개를 앞둔 경계심 작용.

IRS, MBS 미매각 영향에 금리 급등.

CRS, 전 구간 금리 상승.