

IPS Daily Morning Brief

2019-09-09

종가 기준일 2019-09-06

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4475	0.75	1.4215	1.4001	1.5277	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3975	0.75	1.3655	1.3311	1.4604	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3600	1.00	1.3265	1.2771	1.4074	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2975	1.25	1.2635	1.2010	1.3391	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2400	1.25	1.2090	1.1421	1.2844	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2025	1.25	1.1710	1.0949	1.2420	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.1875	1.50	1.1560	1.0754	1.2239	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.1725	1.50	1.1415	1.0628	1.2128	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.1650	1.75	1.1340	1.0564	1.2094	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.1900	1.75	1.1590	1.0785	1.2391	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.2100	1.75	1.1790	1.0984	1.2588	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.1975	2.25	1.1620	1.0796	1.2483	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1225	2.25	1.0870	1.0039	1.2008	2.5300	0.9125	2.5650	0.9125

6*9M	-5.00	0.00	-5.60	-6.90	-6.73	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-3.75	0.25	-3.90	-5.40	-5.30	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-12.00	0.25	-11.75	-13.50	-12.30	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-3.75	0.00	-3.80	-4.73	-4.24	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-5.25	0.25	-5.30	-6.68	-6.05	18.25	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-6.75	0.25	-6.75	-7.94	-7.16	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.50	0.25	-1.50	-1.95	-1.81	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.00	0.25	-2.95	-3.21	-2.93	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.50	0.00	-1.45	-1.26	-1.12	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.75	0.25	-0.75	-0.64	-0.33	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.75	0.25	1.75	1.58	2.63	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	2.50	0.00	2.50	2.21	2.97	7.75	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.99	1.97	4.50	1.50	7.00	-0.25
10*15Y	0.75	0.50	0.30	0.11	0.93	6.75	-0.25	12.50	-0.75
10*20Y	-6.75	0.50	-7.20	-7.46	-3.83	10.25	-8.00	24.25	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.274	1.30	1.245	1.186	1.339	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.303	1.50	1.272	1.190	1.340	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.287	1.00	1.264	1.180	1.327	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.270	1.80	1.239	1.118	1.286	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.328	1.30	1.298	1.214	1.348	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.330	1.00	1.303	1.214	1.342	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.365	1.40	1.335	1.252	1.401	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.380	1.50	1.349	1.262	1.414	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.357	1.20	1.332	1.255	1.421	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.54	1.00
CALL	0.00	-150.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.84	-0.03	110.79	110.87	110.79
LKTb	133.59	-0.22	133.41	133.68	133.39

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	8.60	-0.30	8.19	9.16	6.80	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-0.55	-0.25	-0.85	1.08	-0.13	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-4.70	0.25	-5.52	-3.79	-4.29	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-6.75	-0.55	-6.80	-2.31	-4.39	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-14.05	0.20	-14.22	-13.89	-12.42	-4.50	-21.70	-1.25	-30.35
5Y	-15.75	0.50	-16.13	-15.14	-12.95	-3.20	-27.25	-2.20	-27.25
7Y	-20.00	0.35	-20.10	-19.53	-19.13	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-19.00	0.25	-19.00	-18.32	-17.45	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-23.45	1.05	-24.52	-25.11	-22.06	1.75	-29.50	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1196.90 (-3.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-79.00	-0.50	1Y	0.5700	0.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-24.50	0.00	
-84.75	-0.75	1.5Y	0.4500	0.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-10.00	0.00	
-91.50	-0.75	2Y	0.3250	0.50	1.3750	1.0900	2*5Y	-14.00	0.00	
-97.75	-0.75	3Y	0.2250	0.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-2.00	0.00	
-98.25	-1.00	4Y	0.2050	0.50	1.4700	0.0350	3*5Y	-4.00	0.00	
-98.75	-1.00	5Y	0.1850	0.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-2.00	0.00	
-91.00	-1.25	7Y	0.2550	0.50	1.6600	0.0750	5*7Y	7.00	0.00	
-76.00	-1.25	10Y	0.4300	0.50	1.8550	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	0.0000	-1.5281	1.5281	1.4319	1.4600	2.9773	1.4319	2.9773	0.5400
10Y	0.0000	-1.5653	1.5653	1.4690	1.4607	3.2382	1.4607	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	-128.70	-153.81	25.11	17.69	21.30	103.03	-128.70	103.03	-128.70
10Y	-138.00	-158.03	20.03	13.40	14.07	98.82	-138.00	98.82	-138.00

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-5.00	0.50	-5.50	-5.00	-5.00	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	9.30	0.50	8.80	8.00	7.30	63.50	4.10	82.90	4.10
UST 2*10Y	0.00	-3.72	3.72	3.71	0.07	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor	6y 16.25				
06M	45.75 / 44.75									
09M	40.5 / 39.75									
01Y	37 /36									
1.5Y										
02Y	24				SPRD	6*7y 00				
03Y	20.25 / 20.5 / 21 / 21.25									
04Y	01월 20일									
05Y	18.25									
07Y	17									
10Y	19									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	3y CCS 22.5									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			134 건	21	113	94	103	118	92	68
금 액			55,125 억원	2,170	52,955	29,070	29,747	62,098	36,440	28,330

장중동향
국고채 금리, 미국채 금리 상승과 외인 국채선물 매매 흐름이 연동되며 금리 상승 마감.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.
국내 기준금리 인하 기대에 단기보다는 장기 구간을 중심으로 금리 상승.

CRS, 전 구간 금리 상승.