

IPS Daily Morning Brief

2019-09-17

종가 기준일 2019-09-16

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4675	1.00	1.4585	1.4201	1.5035	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.4275	2.00	1.4095	1.3584	1.4394	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4050	3.50	1.3745	1.3129	1.3894	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3775	5.00	1.3325	1.2480	1.3238	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3375	6.25	1.2820	1.1925	1.2688	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3225	8.25	1.2505	1.1509	1.2278	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3175	9.50	1.2355	1.1338	1.2097	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3150	10.75	1.2230	1.1204	1.1984	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3200	12.00	1.2180	1.1136	1.1948	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3550	12.75	1.2465	1.1379	1.2238	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3700	12.75	1.2620	1.1568	1.2431	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3575	12.75	1.2495	1.1398	1.2318	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2825	12.75	1.1745	1.0641	1.1794	2.5300	0.9125	2.5650	0.9125

6*9M	-4.00	1.00	-4.90	-6.18	-6.40	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.25	1.50	-3.50	-4.55	-5.00	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-6.75	2.75	-9.25	-12.04	-12.06	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-1.50	2.00	-3.15	-4.16	-4.10	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-2.00	3.25	-4.65	-5.88	-5.91	18.25	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-2.25	4.50	-5.90	-7.21	-7.04	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-0.50	1.25	-1.50	-1.71	-1.81	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-0.75	2.50	-2.75	-3.05	-2.93	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.25	1.25	-1.25	-1.34	-1.13	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	0.50	1.25	-0.50	-0.67	-0.36	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	4.00	2.00	2.35	1.75	2.53	14.00	0.50	30.25	0.50
7*10Y	3.50	0.75	2.85	2.43	2.90	7.75	1.75	16.00	1.75
10*12Y	1.50	0.00	1.55	1.89	1.93	4.50	1.50	6.75	-0.25
10*15Y	0.25	0.00	0.30	0.19	0.80	6.75	-0.25	12.00	-0.75
10*20Y	-7.25	0.00	-7.20	-7.38	-4.44	10.25	-8.00	24.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.318	3.50	1.288	1.217	1.315	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.375	6.10	1.323	1.239	1.320	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.362	6.30	1.307	1.231	1.307	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.345	8.00	1.275	1.209	1.266	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.454	10.70	1.360	1.269	1.332	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.440	11.80	1.337	1.264	1.326	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.513	12.80	1.403	1.306	1.383	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.540	13.80	1.422	1.320	1.396	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.457	15.40	1.330	1.293	1.392	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.54	0.00
CALL	1.52	3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.47	-0.33	110.73	110.73	110.44
LKTb	131.85	-1.50	132.85	132.91	131.77

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	8.70	0.00	8.69	9.64	7.40	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	0.25	-1.10	0.91	0.95	0.39	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-2.45	-0.05	-2.52	-3.90	-3.84	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-2.25	0.25	-2.45	-5.81	-3.87	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-13.65	-1.20	-12.47	-13.56	-12.25	-4.50	-21.70	-1.45	-30.35
5Y	-12.50	-1.05	-11.42	-14.34	-12.77	-3.20	-27.25	-2.25	-27.25
7Y	-19.30	-0.80	-18.46	-19.27	-18.77	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-18.50	-1.05	-17.51	-18.17	-17.22	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-17.45	-2.65	-15.51	-22.86	-21.22	1.75	-28.85	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1183.10 (-7.90)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-71.50	-0.50	1Y	0.6900	3.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-28.50	3.00
-84.25	-0.50	1.5Y	0.5350	4.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-9.00	1.50
-93.25	-0.25	2Y	0.4050	6.00	1.3750	1.0900	2*5Y	-13.50	2.00
-100.75	-0.75	3Y	0.3150	7.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-2.50	0.50
-102.75	-1.50	4Y	0.2900	8.00	1.4600	0.0350	3*5Y	-4.50	0.50
-104.50	-2.75	5Y	0.2700	8.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-2.00	0.00
-96.50	-3.50	7Y	0.3550	8.50	1.6000	0.0750	5*7Y	8.50	0.50
-82.50	-4.25	10Y	0.5300	8.50	1.8200	0.2550	5*10Y	26.00	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	1.7655	-0.0324	1.7979	1.7152	1.6865	2.9773	1.4319	2.9773	0.5400
10Y	1.8468	-0.0518	1.8986	1.7734	1.7447	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	40.35	-9.54	49.89	41.62	38.75	103.03	17.69	103.03	-117.20
10Y	30.68	-18.98	49.66	37.14	34.27	98.82	8.95	98.82	-29.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	1.75	6.50	-4.75	-4.75	-4.75	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	17.80	7.50	10.30	10.30	10.30	63.50	4.10	82.90	4.10
UST 2*10Y	8.13	-1.94	10.07	5.82	5.82	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	34.75 / 35 / 35.5								
02Y		SPRD							
03Y	32.5								
04Y									
05Y									
07Y									
10Y	28.75 / 33.5 / 35								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	133 건	133	0	0	101	79	57	134	
금 액	36,640 억원	36,640	0,000	0,000	43,350	18,538	15,076	55,125	

장중동향
국고채 금리, 급등 마감.
추석 연휴 기간 오른 미 국채금리 상승분 한꺼번에 반영. 초장기물 약세. 외인의 국채선물 롤오버 지연도 우려 키워.

IRS, 전 구간 금리 급등.
전 구간 비드쉬한 모습.

CRS, 전 구간 금리 상승.