

IPS Daily Morning Brief

2019-09-19

종가 기준일 2019-09-18

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4500	-0.75	1.4580	1.4264	1.4952	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3975	-1.25	1.4100	1.3675	1.4319	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3575	-2.25	1.3765	1.3249	1.3825	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3200	-3.00	1.3405	1.2639	1.3178	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2800	-3.00	1.2955	1.2099	1.2631	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2550	-3.25	1.2690	1.1711	1.2228	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2400	-3.75	1.2560	1.1549	1.2049	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2325	-3.75	1.2465	1.1416	1.1938	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2300	-4.00	1.2440	1.1351	1.1903	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.2575	-4.50	1.2740	1.1603	1.2193	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.2725	-4.50	1.2890	1.1786	1.2384	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.2650	-4.25	1.2780	1.1628	1.2270	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1875	-4.25	1.2020	1.0871	1.1728	2.5300	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-5.25	-0.50	-4.80	-5.89	-6.33	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.00	-1.00	-3.35	-4.26	-4.94	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-7.75	-0.75	-8.10	-11.50	-11.93	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-2.50	-0.25	-2.65	-3.88	-4.03	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-4.00	-0.75	-3.95	-5.50	-5.82	18.00	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-4.75	-0.75	-4.90	-6.83	-6.93	22.75	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.50	-0.50	-1.30	-1.63	-1.79	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-2.25	-0.50	-2.25	-2.95	-2.90	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.75	0.00	-0.95	-1.33	-1.11	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.25	-0.25	-0.25	-0.65	-0.35	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	2.50	-0.75	2.75	1.86	2.54	14.00	0.50	30.25	0.50
7*10Y	2.75	-0.50	3.00	2.51	2.89	7.75	1.75	15.75	1.75
10*12Y	1.50	0.00	1.50	1.84	1.92	4.50	1.50	6.75	-0.25
10*15Y	0.75	0.25	0.40	0.25	0.77	6.75	-0.25	12.00	-0.75
10*20Y	-7.00	0.25	-7.20	-7.31	-4.65	10.25	-8.00	24.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.310	0.20	1.300	1.233	1.308	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.360	0.00	1.345	1.260	1.314	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.337	-0.80	1.328	1.253	1.301	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.306	-0.90	1.299	1.227	1.261	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.401	-2.00	1.394	1.292	1.328	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.380	-2.20	1.373	1.285	1.322	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.445	-2.80	1.440	1.329	1.378	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.457	-3.50	1.459	1.343	1.392	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.406	-3.00	1.381	1.312	1.385	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.54	0.00
CALL	1.50	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.76	0.07	110.72	110.77	110.65
LKTb	132.86	0.40	132.64	132.86	132.39

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	4.75	-2.45	7.61	9.19	7.48	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-4.00	-3.00	-0.41	0.40	0.41	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-5.70	-2.20	-3.29	-4.31	-3.80	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-5.10	-2.35	-3.02	-5.55	-3.79	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-16.10	-1.75	-13.80	-13.73	-12.32	-4.50	-21.70	-1.45	-30.35
5Y	-14.75	-1.55	-12.67	-14.30	-12.82	-3.20	-27.25	-2.25	-27.25
7Y	-21.50	-1.20	-19.62	-19.43	-18.79	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-19.95	-1.00	-18.46	-18.28	-17.25	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-21.85	-1.25	-17.90	-22.47	-21.19	1.75	-28.85	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1191.30 (+0.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-70.25	-0.25	1Y	0.6550	-2.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-28.00	0.00	
-81.50	0.50	1.5Y	0.5050	-2.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-9.00	0.00	
-90.50	0.50	2Y	0.3750	-2.50	1.3750	1.0900	2*5Y	-13.50	0.00	
-97.00	0.75	3Y	0.2850	-2.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-2.50	0.00	
-98.00	1.25	4Y	0.2600	-2.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-4.50	0.00	
-99.25	1.25	5Y	0.2400	-2.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-2.00	0.00	
-90.50	1.50	7Y	0.3250	-2.50	1.5750	0.0750	5*7Y	8.50	0.00	
-75.75	2.00	10Y	0.5000	-2.50	1.7900	0.2550	5*10Y	26.00	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	1.7580	0.0410	1.7170	1.7655	1.7979	2.9773	1.4319	2.9773	0.5400
10Y	1.7971	0.0096	1.7875	1.8468	1.8986	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	42.10	4.9	37.20	40.35	49.89	103.03	17.69	103.03	-117.20
10Y	34.01	4.46	29.55	30.68	49.66	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	-2.25	-1.50	-0.75	1.75	-4.75	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	12.00	-2.70	14.70	17.80	10.30	63.50	4.10	82.90	4.10
UST 2*10Y	3.91	-3.14	7.05	8.13	10.07	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	11y 29.25						
06M	45								
09M									
01Y	36 / 36.5 / 36.25								
1.5Y	34 / 32 / 33.25								
02Y	30 / 30.25	SPRD	6*9*12m -1.5						
03Y	26.5 / 28.5 / 28		1.5*2y -04						
04Y			1*1.5y -03						
05Y	25.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3*4y CCS -2.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	160 건	42	118	133	0	0	101	79	
금 액	72,640 억원	37,371	35,269	36,640	0,000	0,000	43,350	18,538	

장중동향
국고채 금리, 신인석 금투위원 기자 간담회와 FOMC 결과 발표 기대에 금리 하락.

IRS, 전 구간 오퍼리시한 장세에 금리 하락.
단기구간을 중심으로 기준금리 인하 베팅성 오피 다수.

CRS, 전 구간 고르게 금리 하락.