

IPS Daily Morning Brief

2019-09-30

종가 기준일 2019-09-27

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4775	0.50	1.4740	1.4533	1.4696	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.4125	0.50	1.4120	1.3983	1.4067	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3700	0.50	1.3680	1.3589	1.3585	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3100	0.50	1.3090	1.3061	1.2947	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2625	0.50	1.2605	1.2556	1.2405	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2300	0.25	1.2305	1.2239	1.2018	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2200	0.75	1.2160	1.2093	1.1847	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2050	1.00	1.2000	1.1959	1.1734	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.1900	1.00	1.1880	1.1888	1.1693	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.2150	1.25	1.2120	1.2150	1.1974	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.2300	1.25	1.2270	1.2316	1.2160	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.2200	1.25	1.2185	1.2199	1.2041	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1425	1.25	1.1410	1.1438	1.1444	2.5300	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-6.50	0.00	-6.20	-5.50	-6.30	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.25	0.00	-4.40	-3.94	-4.82	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-10.75	0.00	-10.75	-10.33	-11.79	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-3.25	-0.25	-3.00	-3.18	-3.87	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-4.25	0.25	-4.45	-4.64	-5.59	18.00	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-5.75	0.50	-6.05	-5.98	-6.71	22.75	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.00	0.50	-1.45	-1.46	-1.72	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-2.50	0.75	-3.05	-2.80	-2.84	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.50	0.25	-1.60	-1.34	-1.13	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-1.50	0.00	-1.20	-0.71	-0.42	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.00	0.25	1.20	1.91	2.40	14.00	0.50	30.25	0.50
7*10Y	2.50	0.25	2.40	2.63	2.81	7.75	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.50	0.00	1.50	1.66	1.86	4.25	1.50	6.75	-0.25
10*15Y	0.50	0.00	0.65	0.49	0.68	6.75	-0.25	11.75	-0.75
10*20Y	-7.25	0.00	-7.10	-7.13	-5.30	10.25	-8.00	22.75	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.342	0.00	1.338	1.294	1.286	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.360	-1.00	1.372	1.330	1.296	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.332	-0.80	1.352	1.314	1.284	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.302	0.20	1.314	1.283	1.245	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.377	-0.80	1.398	1.362	1.316	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.362	-0.20	1.380	1.349	1.310	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.433	0.70	1.441	1.403	1.365	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.447	1.20	1.449	1.416	1.378	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.422	0.00	1.433	1.374	1.364	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.55	0.00
CALL	1.54	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.82	0.00	110.82	110.84	110.80
LKTb	132.96	-0.14	133.12	133.21	132.94

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	2.80	0.50	3.00	6.45	7.25	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-5.00	1.50	-6.30	-2.40	-0.14	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-6.95	1.30	-9.13	-5.88	-4.37	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-7.20	0.05	-8.39	-5.88	-4.33	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-15.70	1.55	-18.16	-15.25	-13.15	-4.50	-20.95	-1.45	-30.35
5Y	-15.70	1.20	-17.96	-15.27	-13.66	-3.20	-26.75	-2.25	-27.25
7Y	-24.30	0.30	-25.26	-21.40	-19.57	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-23.20	0.05	-23.74	-20.13	-18.07	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-27.95	1.25	-29.22	-23.00	-22.00	1.75	-30.75	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1199.90 (+1.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-71.50	0.50	1Y	0.6550	1.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-20.00	3.50	
-78.00	1.00	1.5Y	0.5300	1.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-9.50	0.00	
-80.75	4.00	2Y	0.4550	4.50	1.3750	1.0900	2*5Y	-14.00	1.00	
-87.00	4.25	3Y	0.3600	4.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-3.50	0.50	
-89.50	4.25	4Y	0.3250	5.00	1.4600	0.0350	3*5Y	-4.50	1.00	
-89.00	4.50	5Y	0.3150	5.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-1.00	0.50	
-81.50	4.50	7Y	0.3750	5.50	1.5750	0.0750	5*7Y	6.00	0.00	
-67.50	3.75	10Y	0.5400	5.00	1.7900	0.2550	5*10Y	22.50	-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	1.6395	-0.0234	1.6629	1.6825	1.6277	2.9773	1.4319	2.9773	0.5400
10Y	1.6828	-0.0155	1.6983	1.7390	1.6508	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	30.75	-1.54	32.29	33.55	25.77	103.03	17.69	103.03	-117.20
10Y	23.58	-2.75	26.33	31.40	18.08	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	-4.75	0.75	-5.50	-5.50	-4.50	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	11.50	2.00	9.50	7.80	10.00	63.50	4.10	79.50	4.10
UST 2*10Y	4.33	0.79	3.54	5.65	2.31	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	8y 18.5						
06M	47.75								
09M	40.75								
01Y	36.5								
1.5Y									
02Y		SPRD	4*10y -0.75						
03Y			6*12m -10.75						
04Y									
05Y									
07Y									
10Y	21								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	84 건		-41	125	148	62	71	103	238
금 액	23,167 억원		-17,248	40,415	64,274	23,630	18,342	30,435	86,350

장중동향
국고채 금리, 분기말 관망 분위기 속 개인의 국채선물 매도가 악세 재료로 작용하며 약보합 마감.
IRS, 조용한 가운데 현물에 연동되며 금리 상승 마감. 커브 스티프닝.
비디쉬하지만 거래가 거의 없이 잔잔한 움직임.

CRS, 금리 상승. 커브 스티프닝.