IPS Daily Morning Brief

2019-10-02

종가 기준일 2019-10-01

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4775	0.00	1.4745	1.4606	1.4626	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.4125	0.00	1.4100	1.4051	1.4000	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3675	-0.25	1.3665	1.3653	1.3521	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3100	0.50	1.3060	1.3126	1.2887	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2725	1.00	1.2615	1.2633	1.2352	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2475	1.50	1.2320	1.2326	1.1970	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2400	1.75	1.2200	1.2185	1.1803	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2325	2.00	1.2065	1.2056	1.1693	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2250	2.75	1.1935	1.1980	1.1649	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.2500	2.75	1.2175	1.2243	1.1928	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.2650	2.75	1.2325	1.2404	1.2113	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.2550	2.75	1.2230	1.2295	1.1993	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1775	2.75	1.1455	1.1531	1.1380	2.5300	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-6.50	0.00	-6.45	-5.55	-6.27	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.50	-0.25	-4.35	-3.99	-4.79	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-9.50	1.25	-10.50	-10.20	-11.69	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-2.50	0.50	-2.95	-3.06	-3.82	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-3.25	0.75	-4.15	-4.48	-5.50	18.00	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-4.00	1.00	-5.50	-5.76	-6.59	22.75	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-0.75	0.25	-1.20	-1.41	-1.68	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-1.50	0.50	-2.55	-2.70	-2.78	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.75	0.25	-1.35	-1.29	-1.10	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.75	0.75	-1.30	-0.76	-0.44	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.75	0.75	1.10	1.86	2.35	14.00	0.50	30.25	0.50
7*10Y	2.50	0.00	2.40	2.63	2.80	7.75	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.50	0.00	1.50	1.61	1.84	4.00	1.50	6.75	-0.25
10*15Y	0.50	0.00	0.55	0.52	0.65	6.75	-0.25	11.75	-0.75
10*20Y	-7.25	0.00	-7.20	-7.11	-5.48	10.25	-8.00	22.50	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.334	0.00	1.339	1.306	1.281	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.348	0.70	1.358	1.340	1.292	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.347	1.70	1.339	1.323	1.280	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.317	2.00	1.303	1.291	1.241	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.395	2.50	1.382	1.372	1.313	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.375	2.00	1.364	1.356	1.307	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.465	2.90	1.436	1.416	1.363	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.495	3.50	1.452	1.431	1.376	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.475	4.00	1.433	1.387	1.361	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.55	0.00
CALL	1.55	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.75	-0.08	110.84	110.88	110.68
LKTB	132.40	-0.43	132.90	133.04	132.09

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	3.35	-0.25	2.77	5.97	7.09	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-3.80	-0.20	-5.18	-2.70	-0.29	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-7.45	-0.70	-7.77	-5.99	-4.50	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-6.95	-0.50	-7.12	-5.84	-4.44	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-15.50	-0.75	-16.18	-15.33	-13.32	-4.50	-20.95	-1.45	-30.35
5Y	-14.25	0.00	-15.71	-15.08	-13.79	-3.20	-26.75	-2.25	-27.25
7Y	-24.00	-0.15	-24.25	-21.79	-19.77	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-24.50	-0.75	-23.49	-20.66	-18.33	-7.50	-37.00	-7.50	-38.70
20Y	-29.75	-1.25	-28.77	-23.39	-22.29	1.75	-30.75	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-70.25	0.75
-74.50	2.00
-76.25	2.50
-81.25	4.00
-84.00	3.75
-85.75	2.00
-79.00	1.25
-65.00	1.25

CRS

USD/KRW 11990.00 ########

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.6650	0.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-15.50	3.00
1.5Y	0.5650	2.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-7.50	2.00
2Y	0.5100	3.50	1.3750	1.0900	2*5Y	-13.50	0.50
3Y	0.4350	5.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-3.50	0.00
4Y	0.4000	5.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-6.00	-1.50
5Y	0.3750	4.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-2.50	-1.50
7Y	0.4350	4.00	1.5750	0.0750	5*7Y	6.00	0.00
10Y	0.6000	4.00	1.7900	0.2550	5*10Y	22.50	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	1.5479	-0.0678	1.6157	1.6395	1.6629	2.9773	1.4319	2.9773	0.5400
10Y	1.6379	-0.0293	1.6672	1.6828	1.6983	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	20.09	-8.48	28.57	30.75	32.29	103.03	17.69	103.03	-117.20
10Y	14.29	-6.43	20.72	23.58	26.33	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	1.75	-4.00	-4.75	-5.50	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	14.80	1.80	13.00	11.50	9.50	63.50	4.10	79.50	4.10
UST 2*10Y	9.00	3.85	5.15	4.33	3.54	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	47.75	ODD Tenor	
09M			
01Y	36.75		
1.5Y	31.5		
02Y	26.25	SPRD	5*8y -1.25
03Y			6*12m -11
04Y			6m*2y -21.5
05Y			6*9m -6.5
07Y			9m*2y -15
10Y			5*10y 1.75
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	77 건	29	48	84	125	148	62	71
금 액	30,135 억원	10,305	19,830	23,167	40,415	64,274	23,630	18,342

장중동향

국고채 금리, 급등한 일본 국채 금리에 연동되며 금리 상승 마감.

IRS, 대부분 구간에서 금리 상승 마감. 커브 스티프닝.
글로벌 금리 상승에 전반적으로 연동됐지만, 단기 구간은 국내 기준금리 인하 기대를 반영하며 상대적으로 상승하지 못하는 모습.

CRS, 전 구간 금리 상승.