

IPS Daily Morning Brief

2019-10-04

종가 기준일 2019-10-03

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4675	-1.00	1.4755	1.4653	1.4557	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.4000	-1.25	1.4100	1.4086	1.3932	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3550	-1.25	1.3660	1.3683	1.3455	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2950	-1.50	1.3060	1.3161	1.2823	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2550	-1.75	1.2650	1.2685	1.2295	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2275	-2.00	1.2370	1.2390	1.1918	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2200	-2.00	1.2285	1.2258	1.1753	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2125	-2.00	1.2190	1.2136	1.1644	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2075	-1.75	1.2090	1.2063	1.1599	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.2350	-1.50	1.2345	1.2326	1.1877	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.2500	-1.50	1.2495	1.2483	1.2059	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.2400	-1.50	1.2395	1.2381	1.1939	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1625	-1.50	1.1620	1.1615	1.1311	2.5300	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-6.75	-0.25	-6.55	-5.66	-6.25	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.50	0.00	-4.40	-4.04	-4.76	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-10.00	-0.50	-10.10	-9.98	-11.60	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-2.75	-0.25	-2.80	-2.95	-3.77	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-3.50	-0.25	-3.65	-4.28	-5.43	18.00	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-4.25	-0.25	-4.60	-5.49	-6.51	22.75	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-0.75	0.00	-0.85	-1.33	-1.65	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-1.50	0.00	-1.80	-2.54	-2.74	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.75	0.00	-0.95	-1.21	-1.09	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.50	0.25	-1.00	-0.74	-0.45	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	2.25	0.50	1.55	1.90	2.33	14.00	0.50	30.25	0.50
7*10Y	2.75	0.25	2.55	2.64	2.78	7.75	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.50	0.00	1.50	1.56	1.83	4.00	1.50	6.75	-0.25
10*15Y	0.50	0.00	0.50	0.55	0.62	6.75	-0.25	11.75	-0.75
10*20Y	-7.25	0.00	-7.25	-7.11	-5.65	10.25	-8.00	21.00	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.315	-1.90	1.332	1.313	1.277	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.318	-3.00	1.343	1.345	1.287	2.103	1.122	2.113	1.122
2Y	1.305	-4.20	1.332	1.329	1.276	2.210	1.089	2.230	1.089
3Y	1.297	-2.00	1.306	1.298	1.237	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.380	-1.50	1.383	1.381	1.311	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.365	-1.00	1.366	1.363	1.304	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.461	-0.40	1.452	1.429	1.360	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.497	0.20	1.479	1.445	1.374	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.475	0.00	1.456	1.402	1.358	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.55	0.00
CALL	1.50	-5.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.81	0.06	110.87	110.87	110.77
LKTB	132.41	0.01	132.83	132.85	132.30

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	4.00	0.65	3.42	5.55	6.90	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-2.30	1.50	-3.70	-2.89	-0.48	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-5.00	2.45	-6.72	-6.07	-4.60	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-6.95	0.00	-6.90	-5.88	-4.56	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-16.00	-0.50	-15.49	-15.48	-13.53	-4.50	-20.95	-1.45	-30.35
5Y	-15.25	-1.00	-14.74	-14.93	-13.95	-3.20	-26.75	-2.25	-27.25
7Y	-25.35	-1.35	-24.30	-22.24	-20.01	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-26.20	-1.70	-24.43	-21.28	-18.65	-7.50	-36.75	-7.50	-38.70
20Y	-31.25	-1.50	-29.44	-24.01	-22.65	1.75	-31.25	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS			USD/KRW			1206.00 (+7.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-69.00	1.25	1Y	0.6650	0.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-17.50	-2.00
-74.00	0.50	1.5Y	0.5550	-1.00	1.3950	1.0400	2*3Y	-7.00	0.50
-76.50	-0.25	2Y	0.4900	-2.00	1.3750	1.0900	2*5Y	-13.50	0.00
-80.75	0.50	3Y	0.4200	-1.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-3.50	0.00
-83.50	0.50	4Y	0.3850	-1.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-6.50	-0.50
-85.75	0.00	5Y	0.3550	-2.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-3.00	-0.50
-79.25	-0.25	7Y	0.4150	-2.00	1.5750	0.0750	5*7Y	6.00	0.00
-65.50	-0.50	10Y	0.5800	-2.00	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	1.3841	-0.0999	1.4840	1.5479	1.6157	2.9773	1.3841	2.9773	0.5400
10Y	1.5359	-0.0625	1.5984	1.6379	1.6672	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	7.91	-5.79	13.70	20.09	28.57	103.03	7.91	103.03	-117.20
10Y	3.89	-6.45	10.34	14.29	20.72	98.82	3.89	98.82	-29.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-2.00	0.25	-2.25	-2.25	-4.00	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	19.20	4.40	14.80	14.80	13.00	63.50	4.10	79.50	4.10
UST 2*10Y	15.18	3.74	11.44	9.00	5.15	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS		ODD Tenor	6y 20.25							
06M										
09M										
01Y	35.5 / 35.25									
1.5Y	29.25									
02Y	25.5	SPRD	1*2y -10							
03Y	22.75 / 23 / 22.75		3*4y -0.75							
04Y	22		1*4y -13.25							
05Y	21.5 / 21.25		2*3y -2.75							
07Y			2*5y -4.25							
10Y	22.75		3*5y -1.25							
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			108 건	31	77	77	48	84	125	148
금 액			45,475 억원	15,340	30,135	30,135	19,830	23,167	40,415	64,274

장중동향
국고채 금리, 간밤 미 금리 하락했으나 장 후반 유럽금리 상승에 금리 소폭 하락 마감.

IRS, 전 구간 금리 하락.
역외 오피가 전 구간 강하게 유입. 중장기 구간에서는 본드스왑 확대.

CRS, 대부분 구간에서 금리 하락.
최근 금리 급등에 따른 숨고르기 장세.