

IPS Daily Morning Brief

2019-10-08

종가 기준일 2019-10-07

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4550	1.00	1.4625	1.4650	1.4481	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3775	1.25	1.3910	1.4056	1.3853	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3225	1.25	1.3420	1.3636	1.3376	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2500	1.25	1.2775	1.3104	1.2741	1.9900	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.1950	1.50	1.2315	1.2629	1.2212	2.0775	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.1600	2.00	1.2005	1.2333	1.1834	2.1825	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.1450	2.00	1.1900	1.2201	1.1668	2.2575	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.1325	2.00	1.1805	1.2083	1.1558	2.3000	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.1200	2.00	1.1720	1.2005	1.1509	2.3575	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.1450	2.00	1.1980	1.2270	1.1783	2.4350	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.1575	2.00	1.2120	1.2419	1.1963	2.4750	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.1475	2.00	1.2020	1.2320	1.1842	2.4975	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.0700	2.00	1.1245	1.1551	1.1200	2.5225	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-7.75	0.25	-7.15	-5.94	-6.28	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-5.50	0.00	-4.90	-4.20	-4.77	7.75	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-12.75	0.25	-11.05	-10.08	-11.64	20.25	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-3.50	0.50	-3.10	-2.96	-3.78	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-5.00	0.50	-4.15	-4.28	-5.44	18.00	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-6.25	0.50	-5.10	-5.46	-6.54	22.75	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.50	0.00	-1.05	-1.31	-1.66	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-2.75	0.00	-2.00	-2.50	-2.76	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.25	0.00	-0.95	-1.19	-1.10	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-1.25	0.00	-0.85	-0.78	-0.49	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.25	0.00	1.75	1.88	2.25	14.00	0.50	30.25	0.50
7*10Y	2.50	0.00	2.60	2.65	2.74	7.75	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.25	0.00	1.40	1.49	1.80	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	0.25	0.00	0.40	0.50	0.59	6.75	-0.25	11.75	-0.75
10*20Y	-7.50	0.00	-7.35	-7.19	-5.84	10.25	-8.00	20.75	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.278	0.90	1.302	1.312	1.270	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.271	1.60	1.302	1.340	1.280	2.049	1.122	2.113	1.122
2Y	1.254	2.40	1.288	1.323	1.268	2.162	1.089	2.230	1.089
3Y	1.237	3.00	1.271	1.294	1.230	2.265	0.092	2.315	0.092
4Y	1.301	3.40	1.345	1.377	1.304	2.448	1.127	2.502	1.127
5Y	1.282	3.50	1.327	1.357	1.297	2.552	1.122	2.602	1.122
7Y	1.370	2.80	1.420	1.429	1.353	2.684	1.163	2.728	1.163
10Y	1.395	2.30	1.451	1.447	1.368	2.797	1.170	2.815	1.170
20Y	1.389	2.20	1.436	1.405	1.350	2.787	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.55	0.00
CALL	1.49	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.02	-0.07	111.08	111.12	111.00
LKTb	133.54	-0.21	133.75	133.92	133.40

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	4.45	0.35	3.98	5.16	6.72	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-2.10	-0.35	-2.45	-2.95	-0.62	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-5.90	-0.90	-5.67	-6.03	-4.64	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-7.70	-1.00	-7.05	-6.05	-4.69	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-15.60	-1.40	-15.46	-15.66	-13.70	-4.50	-20.95	-1.45	-30.35
5Y	-14.95	-1.50	-14.63	-14.90	-14.08	-3.20	-26.75	-2.25	-27.25
7Y	-25.00	-0.80	-24.78	-22.83	-20.24	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-25.00	-0.30	-25.32	-22.01	-18.95	-7.50	-36.70	-7.50	-38.70
20Y	-31.90	-0.20	-31.17	-25.01	-23.05	1.75	-31.90	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1196.60 (-0.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-70.25	-1.25	1Y	0.6200	0.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-17.50	-0.50	
-74.00	-1.75	1.5Y	0.5100	-0.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-7.00	0.00	
-75.00	-2.00	2Y	0.4450	-0.50	1.3750	1.0900	2*5Y	-13.50	0.00	
-78.50	-2.50	3Y	0.3750	-0.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-3.50	0.00	
-80.50	-2.50	4Y	0.3400	-0.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-6.50	0.00	
-82.25	-2.50	5Y	0.3100	-0.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-3.00	0.00	
-75.00	-2.50	7Y	0.3700	-0.50	1.5750	0.0750	5*7Y	6.00	0.00	
-61.00	-2.50	10Y	0.5350	-0.50	1.7800	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	1.4597	0.0681	1.3916	1.3841	1.4840	2.9773	1.3841	2.9773	0.5400
10Y	1.5632	0.0359	1.5273	1.5359	1.5984	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	20.57	4.41	16.16	7.91	17.90	103.03	7.91	103.03	-117.20
10Y	16.82	1.29	15.53	3.89	10.14	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	-5.00	0.50	-5.50	-2.00	-2.00	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTb 2*10Y	14.10	-0.10	14.20	19.20	19.20	63.50	4.10	79.50	4.10
UST 2*10Y	10.35	-3.22	13.57	15.18	11.44	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y			SPRD	2*5y -07					
03Y	15.75								
04Y									
05Y	33.2								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	79 건		-25	104	0	108	77	48	84
금 액	22,665 억원		-11,005	33,670	0,000	45,475	30,135	19,830	23,167

장종동향

국고채 금리, 쉬어가기 장세에 금리 상승.

전 거래일 금리 하락 되돌림 흐름.

IRS, 국채선물에 연동되며 전 구간 금리 상승.

단기 구간을 중심으로 비디시한 모습.

CRS, 대부분 구간에서 금리 하락.