IPS Daily Morning Brief

2019-10-11

종가 기준일 2019-10-10

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4550	-0.50	1.4550	1.4654	1.4397	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3850	0.00	1.3795	1.4028	1.3767	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3350	0.25	1.3265	1.3588	1.3290	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2675	0.00	1.2580	1.3026	1.2651	1.9775	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2200	0.25	1.2060	1.2558	1.2125	2.0600	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.1900	0.75	1.1710	1.2265	1.1748	2.1675	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.1775	1.00	1.1565	1.2139	1.1582	2.2350	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.1700	1.25	1.1460	1.2029	1.1472	2.2800	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.1625	1.75	1.1345	1.1946	1.1417	2.3375	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.1875	1.75	1.1595	1.2209	1.1684	2.4125	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.2000	1.75	1.1720	1.2353	1.1860	2.4525	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.1900	1.75	1.1620	1.2258	1.1737	2.4775	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1125	1.75	1.0845	1.1485	1.1071	2.5125	0.9125	2.5600	0.9125
6*9M	-7.00	0.50	-7.55	-6.26	-6.30	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-5.00	0.25	-5.30	-4.40	-4.77	6.50	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-11.50	0.00	-12.05	-10.30	-11.65	20.25	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-3.00	0.50	-3.50	-2.93	-3.76	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-4.25	0.75	-4.95	-4.19	-5.43	17.75	-8.25	22.50	-8.25
2*5Y	-5.00	1.00	-6.00	-5.29	-6.53	22.75	-10.00	33.25	-10.00
3*4Y	-1.25	0.25	-1.45	-1.26	-1.67	7.25	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-2.00	0.50	-2.50	-2.36	-2.77	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.75	0.25	-1.05	-1.10	-1.10	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.75	0.50	-1.15	-0.82	-0.55	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.75	0.50	1.35	1.80	2.12	14.00	0.50	30.25	0.50
7*10Y	2.50	0.00	2.50	2.63	2.67	7.75	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.25	0.00	1.25	1.44	1.76	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	0.25	0.00	0.25	0.49	0.53	6.75	-0.25	11.75	-0.75
10*20Y	-7.50	0.00	-7.50	-7.24	-6.13	10.25	-8.00	17.50	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.295	0.80	1.283	1.314	1.264	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.302	1.40	1.281	1.337	1.274	2.049	1.122	2.113	1.122
2Y	1.287	1.20	1.264	1.321	1.261	2.157	1.089	2.230	1.089
3Y	1.275	1.50	1.248	1.295	1.224	2.249	0.092	2.315	0.092
4Y	1.347	2.50	1.312	1.376	1.298	2.424	1.127	2.502	1.127
5Y	1.340	3.50	1.296	1.359	1.291	2.527	1.122	2.602	1.122
7Y	1.432	3.50	1.388	1.434	1.348	2.656	1.163	2.728	1.163
10Y	1.460	3.80	1.414	1.454	1.363	2.765	1.170	2.815	1.170
20Y	1.457	4.00	1.409	1.425	1.344	2.770	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.55	0.00
CALL	1.52	3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.89	-0.06	111.02	111.06	110.88
LKTB	132.78	-0.42	133.47	133.57	132.71

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	4.00	-0.55	4.33	4.51	6.47	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-3.45	-1.40	-2.28	-3.48	-0.87	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-6.70	-0.95	-5.82	-6.55	-4.83	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-8.50	-0.75	-7.68	-6.88	-4.92	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-16.95	-1.50	-15.53	-16.24	-14.02	-4.50	-20.95	-1.45	-30.35
5Y	-17.00	-2.25	-14.98	-15.57	-14.35	-3.20	-26.75	-2.25	-27.25
7Y	-26.95	-1.75	-25.31	-23.97	-20.66	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-27.25	-2.05	-25.47	-23.31	-19.47	-7.50	-36.70	-7.50	-38.70
20Y	-34.45	-2.25	-32.49	-27.69	-23.74	1.75	-34.45	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-73.00	-3.25
-77.75	-4.00
-81.00	-4.75
-85.00	-5.25
-87.25	-5.50
-90.00	-6.25
-82.75	-6.25
-68.75	-6.25

CRS

USD/KRW 1196.20 (+3.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.6050	-3.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-19.50	-1.50
1.5Y	0.4900	-4.00	1.3950	1.0400	2*3Y	-7.00	0.00
2Y	0.4100	-4.50	1.3750	1.0900	2*5Y	-14.00	-0.50
3Y	0.3400	-4.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-3.50	0.00
4Y	0.3050	-4.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-7.00	-0.50
5Y	0.2700	-5.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-3.50	-0.50
7Y	0.3350	-4.50	1.5750	0.0750	5*7Y	6.50	0.50
10Y	0.5000	-4.50	1.7800	0.2550	5*10Y	23.00	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	1.5403	0.0767	1.4636	1.4235	1.4597	2.9773	1.3841	2.9773	0.5400
10Y	1.6725	0.0862	1.5863	1.5333	1.5632	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	25.33	6.47	18.86	14.85	20.57	103.03	7.91	103.03	-117.20
10Y	21.25	4.82	16.43	11.13	16.82	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	-3.25	1.50	-4.75	-4.75	-5.00	35.50	-9.50	62.25	-9.50
KTB 2*10Y	17.30	2.60	14.70	14.70	14.10	61.50	4.10	79.50	4.10
UST 2*10Y	13.22	0.95	12.27	10.98	10.35	49.34	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	
06M	45.75		
09M			
01Y	33.25		
1.5Y			
02Y		SPRD	6*12m -12.5
03Y			
04Y			
05Y	13.75 / 16.75		
07Y			
10Y	14.5 / 14.75		
12Y			
15Y			
20Y			

CRS

2y CCS 42
3y CCS 34
1*2y CCS -20.5

TODAY KRX CCP

	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	74 건	74	0	73	79	104	0	108
금 액	21,610 억원	21,610	0,000	33,445	22,665	33,670	0,000	45,475

장중동향

국고채 금리, 美·中 환율협정 검토에 약세 반전하며 금리 상승 마감.

IRS, 대부분 구간에서 금리 상승.
미중 무역협상과 관련한 이슈에 변동성에 커졌음에도 전반적으로 오퍼 우위.

CRS, 전 구간 금리 하락.