

IPS Daily Morning Brief

2019-10-15

종가 기준일 2019-10-14

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4525	0.25	1.4555	1.4643	1.4371	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3875	0.50	1.3850	1.3995	1.3737	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3425	1.00	1.3350	1.3538	1.3259	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2800	1.25	1.2700	1.2948	1.2616	1.9775	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2325	1.50	1.2210	1.2476	1.2089	2.0450	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2050	1.50	1.1900	1.2181	1.1715	2.1400	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2000	1.50	1.1795	1.2061	1.1551	2.2050	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.1975	1.75	1.1725	1.1956	1.1442	2.2575	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.1925	2.00	1.1635	1.1869	1.1385	2.3125	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.2200	2.00	1.1895	1.2128	1.1647	2.3850	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.2325	2.00	1.2020	1.2269	1.1821	2.4250	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.2225	2.00	1.1920	1.2176	1.1696	2.4525	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1450	2.00	1.1145	1.1401	1.1015	2.4825	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-6.50	0.25	-7.05	-6.48	-6.34	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.50	0.50	-5.00	-4.58	-4.78	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-11.00	0.50	-11.40	-10.61	-11.70	18.25	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-2.75	0.00	-3.10	-2.95	-3.74	10.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-3.25	0.00	-4.15	-4.15	-5.38	17.75	-8.25	22.50	-8.25
2*5Y	-3.50	0.25	-4.85	-5.20	-6.47	22.75	-10.00	33.25	-10.00
3*4Y	-0.50	0.00	-1.05	-1.20	-1.64	7.25	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-0.75	0.25	-1.75	-2.25	-2.73	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.25	0.25	-0.70	-1.05	-1.09	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.50	0.25	-0.90	-0.87	-0.57	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	2.25	0.25	1.70	1.71	2.05	14.00	0.50	30.25	0.50
7*10Y	2.75	0.00	2.60	2.59	2.63	7.75	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.25	0.00	1.25	1.41	1.74	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	0.25	0.00	0.25	0.49	0.49	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-7.50	0.00	-7.50	-7.26	-6.33	10.25	-8.00	16.75	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.293	-0.20	1.291	1.313	1.262	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.312	0.60	1.299	1.334	1.272	2.049	1.122	2.113	1.122
2Y	1.290	0.00	1.283	1.317	1.259	2.140	1.089	2.230	1.089
3Y	1.280	0.50	1.270	1.293	1.222	2.225	0.092	2.315	0.092
4Y	1.360	0.50	1.341	1.372	1.298	2.412	1.127	2.502	1.127
5Y	1.356	0.90	1.331	1.356	1.290	2.522	1.122	2.602	1.122
7Y	1.454	0.40	1.426	1.435	1.349	2.646	1.163	2.728	1.163
10Y	1.484	-0.10	1.455	1.455	1.364	2.752	1.170	2.815	1.170
20Y	1.467	0.00	1.445	1.434	1.344	2.732	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	110.84	-0.04	110.82	110.86	110.78
LKTb	132.53	-0.01	132.15	132.53	132.15

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	4.95	1.20	4.36	4.08	6.37	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-3.20	0.65	-2.92	-3.91	-1.03	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-5.75	1.50	-6.24	-6.96	-4.96	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-7.50	1.00	-8.00	-7.44	-5.08	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-16.00	1.00	-16.17	-16.58	-14.26	-4.50	-20.95	-1.45	-30.35
5Y	-15.85	0.85	-15.81	-16.00	-14.57	-3.20	-26.75	-2.25	-27.25
7Y	-26.15	1.60	-26.25	-24.78	-21.02	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-26.40	2.10	-26.51	-24.26	-19.91	-7.50	-36.70	-7.50	-38.70
20Y	-32.20	2.00	-33.05	-29.40	-24.27	1.75	-34.45	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1184.90 (-3.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-67.75	3.50	1Y	0.6650	4.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-20.50	0.00	
-73.50	3.25	1.5Y	0.5450	4.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-5.50	1.50	
-77.25	3.00	2Y	0.4600	4.50	1.3750	1.0900	2*5Y	-10.50	3.50	
-80.00	4.50	3Y	0.4050	6.00	1.4100	0.0450	3*4Y	-2.00	1.50	
-81.50	6.00	4Y	0.3850	7.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-5.00	2.00	
-84.25	6.25	5Y	0.3550	8.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-3.00	0.50	
-76.75	6.00	7Y	0.4250	8.00	1.5750	0.0750	5*7Y	7.00	0.00	
-63.00	6.00	10Y	0.5900	8.00	1.7800	0.2550	5*10Y	23.50	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	1.5934	0.0000	1.5934	1.5403	1.4636	2.9773	1.3841	2.9773	0.5400
10Y	1.7318	0.0000	1.7318	1.6725	1.5863	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	30.34	0	30.34	25.33	18.86	103.03	7.91	103.03	-117.20
10Y	24.78	0.10	24.68	21.25	16.43	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	-1.25	0.50	-1.75	-3.25	-4.75	35.50	-9.50	62.25	-9.50
KTb 2*10Y	19.40	-0.10	19.50	17.30	14.70	61.50	4.10	79.50	4.10
UST 2*10Y	13.84	0.00	13.84	13.22	12.27	45.69	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	27.75								
02Y		SPRD	4*5y -0.5						
03Y			5*7y -0.5						
04Y			4*7y -01						
05Y	19.5 / 19.75		6*7y 00						
07Y			1*2y -10.75 / -11						
10Y			5*10y 02 / 2.25						
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	73 건	-7	80	74	0	73	79	104	
금 액	27,342 억원	-4,493	31,835	21,610	0,000	33,445	22,665	33,670	

장중동향
국고채 금리, 장중 금리 상승세를 이어가지 못하고 보합권 마감.
10월 금투위 앞두고 저가 매수가 유입된 것으로 풀이.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.
장 후반 국채선물과 채권 현물 금리가 보합수준까지 회복했지만, IRS는 상대적으로 약한 모습.
그간 늘렸던 금리를 재조정 하는 느낌.

CRS, 전 구간 금리 상승.