IPS Daily Morning Brief

2019-10-21

종가 기준일 2019-10-18

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3575	-1.25	1.4015	1.4496	1.4309	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.3450	-1.50	1.3655	1.3896	1.3693	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3275	-1.75	1.3370	1.3469	1.3226	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3100	-1.50	1.3015	1.2908	1.2597	1.9775	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2850	-1.25	1.2655	1.2461	1.2080	2.0450	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2875	-0.25	1.2495	1.2190	1.1715	2.1400	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2900	0.00	1.2470	1.2093	1.1555	2.2050	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2900	0.25	1.2455	1.2004	1.1448	2.2575	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2975	1.25	1.2440	1.1921	1.1389	2.3125	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3275	1.25	1.2720	1.2180	1.1641	2.3850	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3450	1.50	1.2870	1.2323	1.1812	2.4250	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3350	1.50	1.2770	1.2226	1.1684	2.4525	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2575	1.50	1.1995	1.1451	1.0971	2.4825	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-1.25	-0.25	-3.60	-6.00	-6.16	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-1.75	-0.25	-2.85	-4.28	-4.68	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-4.25	0.50	-7.15	-10.08	-11.46	17.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.25	1.00	-1.60	-2.71	-3.65	10.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	0.50	1.25	-1.85	-3.69	-5.25	17.75	-8.25	22.50	-8.25
2*5Y	0.50	1.50	-2.00	-4.58	-6.32	22.75	-10.00	33.25	-10.00
3*4Y	0.25	0.25	-0.25	-0.98	-1.60	7.25	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	0.25	0.50	-0.40	-1.86	-2.66	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	0.00	0.25	-0.15	-0.89	-1.06	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	0.75	1.00	-0.15	-0.82	-0.59	5.75	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	3.75	1.00	2.65	1.76	1.93	12.75	0.50	30.25	0.50
7*10Y	3.00	0.00	2.80	2.59	2.52	7.50	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.75	0.25	1.50	1.43	1.71	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	0.75	0.25	0.50	0.46	0.43	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-7.00	0.25	-7.25	-7.29	-6.70	10.25	-8.00	16.75	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.305	0.20	1.295	1.309	1.260	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.350	0.80	1.327	1.327	1.272	2.049	1.122	2.113	1.122
2Y	1.362	0.00	1.325	1.314	1.259	2.140	1.089	2.230	1.089
3Y	1.375	-0.50	1.328	1.297	1.224	2.225	0.092	2.315	0.092
4Y	1.460	0.40	1.410	1.374	1.302	2.412	1.127	2.502	1.127
5Y	1.462	0.70	1.408	1.361	1.294	2.522	1.122	2.602	1.122
7Y	1.559	1.00	1.506	1.447	1.355	2.646	1.163	2.728	1.163
10Y	1.592	1.20	1.539	1.472	1.371	2.752	1.170	2.815	1.170
20Y	1.585	3.00	1.524	1.458	1.351	2.732	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.36	0.00
CALL	1.24	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.47	0.00	110.50	10.52	110.42
LKTB	131.26	-0.12	131.47	131.56	131.23

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	2.25	-1.95	4.16	3.81	6.30	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-4.00	-2.30	-2.55	-3.58	-1.19	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-7.70	-1.25	-5.97	-6.80	-5.06	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-8.75	0.25	-7.85	-7.77	-5.28	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-17.00	-0.40	-16.26	-16.45	-14.64	-4.50	-20.95	-1.45	-30.35
5Y	-17.20	-0.45	-16.27	-16.09	-14.95	-3.20	-26.75	-2.25	-27.25
7Y	-26.15	0.25	-26.22	-25.51	-21.61	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-26.45	0.05	-26.66	-25.43	-20.71	-7.50	-36.70	-7.50	-38.70
20Y	-32.75	-1.50	-32.43	-31.28	-25.38	1.75	-34.45	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-61.75	1.75
-70.50	2.00
-76.00	2.25
-78.75	2.25
-79.00	2.00
-79.50	2.75
-73.25	1.75
-59.75	1.75

CRS

USD/KRW 1181.50 (-5.50)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.7100	0.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-18.50	1.00
1.5Y	0.6050	0.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-2.50	1.00
2Y	0.5250	1.00	1.3750	1.0900	2*5Y	-3.00	2.00
3Y	0.5000	2.00	1.4100	0.0450	3*4Y	0.00	0.00
4Y	0.5000	2.00	1.4600	0.0350	3*5Y	-0.50	1.00
5Y	0.4950	3.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-0.50	1.00
7Y	0.5650	3.00	1.5750	0.0750	5*7Y	7.00	0.00
10Y	0.7300	3.00	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	1.5777	-0.0161	1.5938	1.5814	1.6180	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.7529	-0.0017	1.7546	1.7441	1.7738	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	21.57	-1.61	23.18	26.44	32.30	103.03	7.91	103.03	-109.00
10Y	16.09	-1.37	17.46	21.71	26.38	98.82	3.89	98.82	-26.00

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	4.25	2.50	1.75	-0.50	-1.00	35.50	-9.50	62.25	-9.50
KTB 2*10Y	23.00	1.20	21.80	21.00	21.50	61.50	4.10	79.20	4.10
UST 2*10Y	17.52	1.44	16.08	16.27	15.58	44.94	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	36.25 / 36	ODD Tenor	
09M	35.75 / 35.5		
01Y			
1.5Y	31.75 / 32.25		
02Y	29.5 / 29.75 / 28.5	SPRD	5*10y 03
03Y	29.5		1.5*2y -2.5
04Y	29 / 29.25 / 28.5		
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	195 건	4	191	99	120	73	80	74
금 액	76,587 억원	-3,860	80,447	37,414	54,720	27,342	31,835	21,610

장중동향

국고채 금리, 금리 널뛰기 후 장기물 위주로 금리 상승. 투심 악화 지속.
장기물 경계심리 반영. 장중 변동성이 컸던 하루.

IRS, 금리 혼조 마감. 커브 스티프닝.
단기구간을 중심으로 역외 오퍼 유입되면서 스팁되며 커브 정상화 움직임.
3Y 이하 구간에서 오퍼, 10Y 비드 우위

CRS, 금리 상승 마감.