

IPS Daily Morning Brief

2019-10-24

종가 기준일 2019-10-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3625	0.25	1.3640	1.4333	1.4257	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.3475	0.00	1.3520	1.3804	1.3661	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3250	0.00	1.3330	1.3413	1.3204	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3000	-0.25	1.3135	1.2909	1.2593	1.9775	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2725	-0.25	1.2880	1.2499	1.2087	2.0450	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2750	-0.50	1.2900	1.2279	1.1739	2.1400	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2850	-1.00	1.2980	1.2224	1.1594	2.2050	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2925	-1.50	1.3035	1.2174	1.1495	2.2575	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2975	-2.50	1.3115	1.2124	1.1442	2.3125	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3400	-2.25	1.3470	1.2405	1.1695	2.3850	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3575	-2.25	1.3640	1.2551	1.1865	2.4250	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3525	-2.25	1.3565	1.2458	1.1736	2.4525	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2800	-2.00	1.2810	1.1688	1.1003	2.4825	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-1.50	-0.25	-1.20	-5.29	-5.95	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.25	0.00	-1.90	-3.91	-4.58	5.75	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-5.25	-0.25	-4.50	-9.14	-11.17	17.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.25	-0.25	0.20	-2.20	-3.48	10.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	1.25	-0.75	1.00	-2.75	-4.93	17.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	2.00	-1.25	1.55	-3.25	-5.91	22.75	-10.00	29.50	-10.00
3*4Y	1.00	-0.50	0.80	-0.55	-1.45	7.25	-3.25	10.00	-3.25
3*5Y	1.75	-1.00	1.35	-1.05	-2.43	12.50	-5.25	20.00	-5.25
4*5Y	0.75	-0.50	0.55	-0.50	-0.98	5.25	-2.25	10.00	-2.25
5*7Y	0.50	-1.00	0.80	-0.50	-0.54	5.75	-1.75	14.25	-1.75
5*10Y	4.75	-0.75	4.35	2.31	2.00	12.75	0.50	29.50	0.50
7*10Y	4.25	0.25	3.55	2.81	2.53	7.50	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.75	0.00	1.70	1.46	1.70	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	1.25	0.00	0.95	0.52	0.41	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-6.00	0.25	-6.60	-7.18	-6.92	10.25	-8.00	16.75	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.331	1.30	1.316	1.307	1.260	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.376	1.00	1.362	1.326	1.274	2.049	1.122	2.113	1.122
2Y	1.372	1.20	1.369	1.316	1.262	2.140	1.089	2.230	1.089
3Y	1.380	1.00	1.383	1.306	1.229	2.225	0.092	2.315	0.092
4Y	1.479	0.80	1.475	1.385	1.309	2.412	1.127	2.502	1.127
5Y	1.487	0.50	1.481	1.377	1.302	2.522	1.122	2.602	1.122
7Y	1.599	0.10	1.586	1.471	1.366	2.646	1.163	2.728	1.163
10Y	1.642	-0.50	1.626	1.502	1.384	2.752	1.170	2.815	1.170
20Y	1.660	0.50	1.623	1.491	1.365	2.732	1.146	2.792	1.146

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.42	-0.02	110.47	110.50	110.36
LKTb	130.66	0.06	130.75	130.92	130.39

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	-0.60	-1.30	1.72	3.42	6.06	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-7.60	-1.25	-4.83	-3.50	-1.50	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-9.95	-1.45	-8.06	-6.59	-5.32	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-10.50	-1.50	-9.34	-7.84	-5.48	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-19.40	-1.80	-17.70	-16.30	-14.99	-4.50	-20.85	-1.45	-30.35
5Y	-19.45	-2.00	-17.77	-15.97	-15.29	-3.20	-26.75	-2.25	-27.25
7Y	-30.15	-2.60	-27.49	-25.89	-22.18	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-30.20	-1.75	-27.90	-26.14	-21.42	-7.50	-36.70	-7.50	-38.70
20Y	-38.00	-2.50	-34.22	-32.19	-26.43	1.75	-38.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1172.40 (+2.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-62.50	-2.50	1Y	0.7000	-2.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-16.00	-0.50	
-69.00	-2.75	1.5Y	0.6100	-3.00	1.3950	1.0650	2*3Y	-3.00	-1.50	
-73.25	-2.75	2Y	0.5400	-3.00	1.3750	1.1200	2*5Y	-3.00	-3.00	
-76.50	-4.00	3Y	0.5100	-4.50	1.4100	0.0450	3*4Y	0.00	-1.00	
-77.50	-4.50	4Y	0.5100	-5.50	1.4600	0.0350	3*5Y	0.00	-1.50	
-78.25	-4.50	5Y	0.5100	-6.00	1.5300	0.0150	4*5Y	0.00	-0.50	
-71.75	-3.50	7Y	0.5800	-6.00	1.5750	0.0750	5*7Y	7.00	0.00	
-59.50	-3.75	10Y	0.7450	-6.00	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	1.5750	-0.0276	1.6026	1.6189	1.5777	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.7688	0.0018	1.7670	1.8047	1.7529	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	20.30	-3.96	24.26	23.19	21.57	103.03	7.91	103.03	-108.00
10Y	12.68	0.68	12.00	13.57	16.09	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	6.75	-2.00	8.75	8.00	4.25	35.50	-9.50	59.00	-9.50
KTb 2*10Y	27.00	-1.70	28.70	28.20	23.00	61.50	4.10	75.70	4.10
UST 2*10Y	19.38	2.94	16.44	18.58	17.52	44.62	-23.40	169.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS				ODD Tenor						
06M										
09M										
01Y	32.5									
1.5Y	31 / 30									
02Y	28.25 / 27 / 26.75			SPRD	5*10y	05				
03Y	27				1.5*2y	-03				
04Y					1*1.5y	-2.5				
05Y	28.5 / 28.75 /28.5				1*2y	-5.25				
07Y					3*9y	5.75				
10Y	33.25				5*7y	0.5				
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	3y CCS 51									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6		
거래현황	157 건	39	118	96	195	191	99	120		
금 액	42,535 억원	3,110	39,425	35,375	76,587	80,447	37,414	54,720		

장중동향
국고채 금리, 10년을 제외한 구간에서 금리 상승.
외인이 국채선물을 대거 매도하면서 약세 주도하는 가운데 단기를 매도가 장기보다 강하게 나타나.

IRS, 1.5Y 이상 구간에서 금리 하락하며 혼조 마감. 커브 플랫트닝.
2Y과 5Y를 중심으로 활발.

CRS, 전 구간 금리 하락 마감.