

IPS Daily Morning Brief

2019-10-29

종가 기준일 2019-10-28

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4400	3.25	1.3935	1.4241	1.4250	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4425	4.75	1.3830	1.3798	1.3677	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4425	6.00	1.3675	1.3454	1.3235	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4250	6.25	1.3450	1.3010	1.2645	1.9775	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.4050	6.75	1.3185	1.2630	1.2152	2.0450	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.4075	7.75	1.3170	1.2449	1.1822	2.1400	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.4075	7.75	1.3225	1.2413	1.1690	2.2050	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.4100	7.75	1.3285	1.2389	1.1598	2.2575	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.4100	7.50	1.3335	1.2364	1.1546	2.3125	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.4450	7.25	1.3720	1.2664	1.1804	2.3850	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4575	7.00	1.3870	1.2808	1.1970	2.4250	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.4550	7.25	1.3820	1.2721	1.1841	2.4525	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3850	7.25	1.3105	1.1963	1.1093	2.4825	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	0.25	1.50	-1.05	-4.44	-5.73	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	0.00	1.25	-1.55	-3.44	-4.41	5.75	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-3.75	0.75	-4.90	-8.24	-10.83	17.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.25	1.00	-0.15	-1.81	-3.30	10.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	0.25	1.00	0.40	-2.18	-4.62	17.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	0.50	1.00	1.00	-2.41	-5.54	22.75	-10.00	27.50	-10.00
3*4Y	0.00	0.00	0.55	-0.36	-1.31	7.25	-3.25	9.50	-3.25
3*5Y	0.25	0.00	1.15	-0.60	-2.23	12.25	-5.25	18.75	-5.25
4*5Y	0.25	0.00	0.60	-0.24	-0.92	5.25	-2.25	9.25	-2.25
5*7Y	0.00	-0.25	0.50	-0.25	-0.52	5.50	-1.75	14.00	-1.75
5*10Y	3.50	-0.50	4.35	2.75	2.05	12.75	0.50	29.50	0.50
7*10Y	3.50	-0.25	3.85	3.00	2.58	7.50	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.25	-0.25	1.50	1.44	1.66	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	1.00	0.00	1.00	0.57	0.37	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-6.00	0.00	-6.15	-7.01	-7.11	10.25	-8.00	16.75	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.428	4.80	1.361	1.314	1.265	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.480	6.00	1.407	1.337	1.282	2.049	1.122	2.113	1.122
2Y	1.505	7.30	1.413	1.332	1.271	2.140	1.089	2.230	1.089
3Y	1.530	8.50	1.424	1.330	1.239	2.225	0.092	2.315	0.092
4Y	1.629	9.10	1.522	1.412	1.323	2.412	1.127	2.502	1.127
5Y	1.635	9.00	1.529	1.407	1.317	2.522	1.122	2.602	1.122
7Y	1.739	9.00	1.637	1.506	1.383	2.646	1.163	2.728	1.163
10Y	1.777	9.20	1.678	1.540	1.402	2.752	1.170	2.815	1.170
20Y	1.772	8.50	1.685	1.532	1.384	2.732	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.44	7.00
CALL	1.24	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.94	-0.29	110.21	110.23	109.94
LKTB	129.27	-1.03	130.18	130.25	129.27

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	1.45	1.20	0.69	3.15	5.87	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-5.50	0.25	-6.18	-3.59	-1.73	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-10.00	-0.55	-9.41	-6.92	-5.55	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-12.25	-0.75	-10.74	-8.51	-5.73	92.30	-12.25	92.30	-19.50
4Y	-22.15	-1.35	-19.95	-17.06	-15.44	-4.50	-22.15	-1.45	-30.35
5Y	-22.50	-1.25	-20.07	-16.80	-15.72	-3.20	-26.50	-2.25	-27.25
7Y	-32.90	-1.50	-30.37	-26.96	-22.83	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-33.20	-1.95	-30.56	-27.34	-22.17	-7.50	-36.70	-7.50	-38.70
20Y	-38.70	-1.25	-37.47	-33.60	-27.44	1.75	-38.70	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS				USD/KRW		1170.70 (-2.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-69.25	-2.00	1Y	0.7500	4.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-11.00	3.00
-71.50	1.75	1.5Y	0.7100	8.00	1.3950	1.1050	2*3Y	1.00	2.50
-76.50	0.25	2Y	0.6400	7.00	1.3750	1.1550	2*5Y	0.50	3.00
-75.75	1.75	3Y	0.6500	9.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	-0.50
-76.25	1.25	4Y	0.6450	9.00	1.4600	0.0350	3*5Y	-0.50	0.50
-76.50	2.25	5Y	0.6450	10.00	1.5300	0.0150	4*5Y	0.00	1.00
-70.00	2.50	7Y	0.7100	10.00	1.5750	0.0750	5*7Y	6.50	0.00
-57.00	2.75	10Y	0.8750	10.00	1.7800	0.2550	5*10Y	23.00	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	1.6511	0.0161	1.6350	1.5712	1.5750	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.8466	0.0504	1.7962	1.7679	1.7688	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	14.61	-5.69	20.30	17.72	20.30	103.03	7.91	103.03	-108.00
10Y	6.96	-4.16	11.12	13.09	12.68	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	4.00	0.50	3.50	3.75	6.75	35.50	-9.50	56.50	-9.50
KTb 2*10Y	27.20	1.90	25.30	24.30	27.00	61.30	4.10	74.30	4.10
UST 2*10Y	19.55	3.43	16.12	19.67	19.38	44.62	-23.40	165.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M	41.5								
09M									
01Y	41.5 / 43								
1.5Y									
02Y	38	SPRD	3*10y 4.5						
03Y	34.5								
04Y	38.75 / 39								
05Y	38.5 / 39.5 / 41								
07Y									
10Y	44.5								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	142 건	14	128	160	157	118	96	195	
금 액	59,940 억원	23,444	36,496	71,225	42,535	39,425	35,375	76,587	

장종동향

국고채 금리, 투자심리 악화에 금리 급등 마감.

외인 국채선물 매도, 해외 금리 상승, 국내기관 손절성 매도, 국고채 입찰 헤지물량 출회 등 악재 물려.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.

오전에 CD발행이 안됐던게 투자심리 악화에 큰 영향.

CRS, 전 구간 금리 상승.