

IPS Daily Morning Brief

2019-10-31

종가 기준일 2019-10-30

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4250	-1.50	1.4220	1.4201	1.4263	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4150	-1.75	1.4135	1.3815	1.3710	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3975	-2.50	1.4015	1.3503	1.3285	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3725	-2.50	1.3785	1.3093	1.2714	1.9775	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3425	-3.00	1.3520	1.2724	1.2231	2.0450	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3475	-2.75	1.3505	1.2573	1.1919	2.1400	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3525	-2.75	1.3530	1.2549	1.1798	2.2050	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3550	-3.00	1.3565	1.2536	1.1711	2.2475	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3575	-3.00	1.3585	1.2520	1.1661	2.3000	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3925	-3.00	1.3945	1.2829	1.1924	2.3725	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4075	-2.75	1.4080	1.2971	1.2089	2.4125	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.4050	-2.75	1.4040	1.2893	1.1964	2.4400	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3350	-2.75	1.3340	1.2141	1.1208	2.4700	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-1.00	-0.25	-0.85	-3.86	-5.53	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-1.75	-0.75	-1.20	-3.13	-4.25	5.75	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-5.50	-0.50	-4.95	-7.79	-10.54	17.00	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.50	0.25	-0.15	-1.51	-3.13	10.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	1.00	0.25	0.10	-1.75	-4.33	17.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	1.25	0.00	0.45	-1.88	-5.20	22.75	-10.00	27.50	-10.00
3*4Y	0.50	0.00	0.25	-0.24	-1.21	7.25	-3.25	9.50	-3.25
3*5Y	0.75	-0.25	0.60	-0.36	-2.08	12.25	-5.25	18.75	-5.25
4*5Y	0.25	-0.25	0.35	-0.13	-0.87	5.00	-2.25	9.25	-2.25
5*7Y	0.25	0.00	0.20	-0.16	-0.50	5.50	-1.75	14.00	-1.75
5*10Y	3.75	0.00	3.80	2.93	2.13	12.75	0.50	29.50	0.50
7*10Y	3.50	0.00	3.60	3.09	2.63	7.50	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.50	0.25	1.35	1.43	1.65	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	1.25	0.25	0.95	0.64	0.40	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-5.75	0.25	-6.05	-6.88	-7.15	10.25	-8.00	16.75	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.405	-0.70	1.394	1.322	1.271	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.448	-0.80	1.439	1.349	1.290	2.049	1.122	2.113	1.122
2Y	1.455	-1.00	1.450	1.346	1.280	2.137	1.089	2.230	1.089
3Y	1.467	-2.00	1.465	1.347	1.250	2.225	0.092	2.315	0.092
4Y	1.575	-2.10	1.566	1.432	1.337	2.392	1.127	2.502	1.127
5Y	1.587	-2.30	1.575	1.430	1.331	2.500	1.122	2.602	1.122
7Y	1.699	-2.20	1.682	1.531	1.399	2.639	1.163	2.728	1.163
10Y	1.743	-2.30	1.722	1.566	1.419	2.730	1.170	2.815	1.170
20Y	1.725	-3.30	1.719	1.559	1.400	2.716	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.44	0.00
CALL	1.26	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.13	0.06	110.06	110.20	110.00
LKTB	129.61	0.26	129.29	129.91	129.21

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	-0.75	-1.80	0.73	2.80	5.78	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-7.55	-1.70	-6.07	-3.96	-1.87	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-11.25	-2.00	-9.82	-7.32	-5.69	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-11.95	-0.75	-11.47	-8.97	-5.83	92.30	-12.25	92.30	-19.50
4Y	-22.25	-0.65	-21.32	-17.67	-15.72	-4.50	-22.25	-1.45	-30.35
5Y	-23.20	-0.70	-21.83	-17.61	-15.98	-3.20	-26.50	-2.25	-27.25
7Y	-34.15	-0.80	-32.33	-27.87	-23.26	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-35.05	-0.70	-32.71	-28.27	-22.65	-7.50	-36.55	-7.50	-38.70
20Y	-39.00	0.55	-38.48	-34.48	-27.92	1.75	-39.55	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS		USD/KRW				1168.10 (+5.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-65.25	3.50	1Y	0.7450	1.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-9.00	0.50
-66.25	3.50	1.5Y	0.7100	1.00	1.3950	1.1050	2*3Y	0.00	0.00
-68.75	4.50	2Y	0.6550	1.50	1.3750	1.1550	2*5Y	-1.00	-0.50
-69.25	4.25	3Y	0.6550	1.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00
-70.25	4.25	4Y	0.6500	1.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-1.00	-0.50
-71.00	4.00	5Y	0.6450	1.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-0.50	-0.50
-64.75	4.00	7Y	0.7100	1.00	1.5750	0.0750	5*7Y	6.50	0.00
-51.75	4.00	10Y	0.8750	1.00	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	1.5996	-0.0477	1.6473	1.6511	1.6350	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.7769	-0.0617	1.8386	1.8466	1.7962	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	14.46	-3.77	18.23	14.61	20.30	103.03	7.91	103.03	-108.00
10Y	3.39	-3.87	7.26	6.96	11.12	98.82	3.39	98.82	-26.00

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	5.00	0.00	5.00	4.00	3.50	35.50	-9.50	56.50	-9.50
KTb 2*10Y	28.80	-1.30	30.10	27.20	25.30	61.30	4.10	74.30	4.10
UST 2*10Y	17.73	-1.40	19.13	19.55	16.12	43.77	-23.40	159.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6y 36.5						
06M									
09M									
01Y	40.25 / 40.5 / 40.75								
1.5Y									
02Y	34.75	SPRD	6*12m -02						
03Y	35 / 35.75		2*3y 0.2						
04Y	36		4*12y 5.25						
05Y	35		5*12y 5.25						
07Y									
10Y									
12Y	42.5								
15Y									
20Y									
CRS	2*3y CCS -0.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	81 건	-41	122	142	128	160	157	118	
금 액	23,695 억원	-14,170	37,865	59,940	36,496	71,225	42,535	39,425	

장중동향

국고채 금리, 미 FOMC 기준금리 결정을 앞두고 금리 하락.

높은 금리 레벨이 저가 매수가 물리며 강세.

IRS, 전 구간 금리 하락.

CD금리를 한번에 반영한 후 단기구간을 중심으로 역외 오퍼가 계속 나오지만 비드 물량은 후퇴.

CRS, 금리 소폭 상승 마감.