IPS Daily Morning Brief

2019-10-16

종가 기준일 2019-10-15

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4575	0.50	1.4550	1.4643	1.4363	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.3925	0.50	1.3865	1.3986	1.3727	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3500	0.75	1.3385	1.3523	1.3248	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2950	1.50	1.2755	1.2920	1.2605	1.9775	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2475	1.50	1.2270	1.2445	1.2077	2.0450	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2200	1.50	1.1975	1.2148	1.1703	2.1400	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2150	1.50	1.1890	1.2030	1.1539	2.2050	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2125	1.50	1.1835	1.1928	1.1431	2.2575	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2100	1.75	1.1765	1.1839	1.1373	2.3125	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.2375	1.75	1.2030	1.2095	1.1633	2.3850	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.2525	2.00	1.2160	1.2236	1.1805	2.4250	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.2425	2.00	1.2060	1.2144	1.1680	2.4525	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1650	2.00	1.1285	1.1369	1.0990	2.4825	0.9125	2.5600	0.9125
6*9M	-6.50	0.00	-6.85	-6.56	-6.36	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.25	0.25	-4.80	-4.64	-4.78	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-10.25	0.75	-11.15	-10.78	-11.71	18.25	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-2.75	0.00	-2.95	-2.98	-3.75	10.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-3.25	0.00	-3.80	-4.15	-5.38	17.75	-8.25	22.50	-8.25
2*5Y	-3.50	0.00	-4.35	-5.18	-6.46	22.75	-10.00	33.25	-10.00
3*4Y	-0.50	0.00	-0.85	-1.18	-1.63	7.25	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-0.75	0.00	-1.40	-2.20	-2.72	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.25	0.00	-0.55	-1.03	-1.08	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.25	0.25	-0.70	-0.89	-0.58	5.75	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	2.50	0.25	1.95	1.68	2.02	13.50	0.50	30.25	0.50
7*10Y	2.75	0.00	2.65	2.56	2.60	7.75	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.50	0.25	1.30	1.41	1.73	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	0.50	0.25	0.30	0.49	0.47	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-7.25	0.25	-7.45	-7.26	-6.42	10.25	-8.00	16.75	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.289	-0.40	1.292	1.312	1.261	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.314	0.20	1.304	1.332	1.271	2.049	1.122	2.113	1.122
2Y	1.295	0.50	1.287	1.315	1.257	2.140	1.089	2.230	1.089
3Y	1.285	0.50	1.275	1.291	1.221	2.225	0.092	2.315	0.092
4Y	1.371	1.10	1.351	1.369	1.297	2.412	1.127	2.502	1.127
5Y	1.371	1.50	1.344	1.354	1.290	2.522	1.122	2.602	1.122
7Y	1.474	2.00	1.441	1.435	1.349	2.646	1.163	2.728	1.163
10Y	1.510	2.60	1.472	1.456	1.364	2.752	1.170	2.815	1.170
20Y	1.502	3.50	1.462	1.437	1.345	2.732	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.55	0.00
CALL	1.52	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.79	-0.05	110.85	110.88	110.78
LKTB	132.18	-0.35	132.58	132.74	132.18

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	6.10	1.15	4.67	4.02	6.36	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-1.90	1.30	-2.89	-3.96	-1.07	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-4.75	1.00	-6.04	-7.02	-4.98	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-6.50	1.00	-7.75	-7.63	-5.12	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-15.60	0.40	-16.20	-16.65	-14.35	-4.50	-20.95	-1.45	-30.35
5Y	-15.85	0.00	-16.03	-16.13	-14.67	-3.20	-26.75	-2.25	-27.25
7Y	-26.40	-0.25	-26.49	-25.08	-21.17	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-27.25	-0.85	-26.92	-24.68	-20.12	-7.50	-36.70	-7.50	-38.70
20Y	-33.70	-1.50	-33.35	-30.05	-24.55	1.75	-34.45	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-70.00	-2.25
-76.50	-3.00
-80.75	-3.50
-83.50	-3.50
-85.00	-3.50
-87.75	-3.50
-80.50	-3.75
-66.75	-3.75

CRS

USD/KRW 1185.20 (+0.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.6500	-1.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-21.00	-0.50
1.5Y	0.5300	-1.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-5.50	0.00
2Y	0.4400	-2.00	1.3750	1.0900	2*5Y	-10.50	0.00
3Y	0.3850	-2.00	1.4100	0.0450	3*4Y	-2.00	0.00
4Y	0.3650	-2.00	1.4600	0.0350	3*5Y	-5.00	0.00
5Y	0.3350	-2.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-3.00	0.00
7Y	0.4050	-2.00	1.5750	0.0750	5*7Y	7.00	0.00
10Y	0.5700	-2.00	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	1.6180	0.0246	1.5934	1.5934	1.5403	2.9773	1.3841	2.9773	0.5400
10Y	1.7738	0.0420	1.7318	1.7318	1.6725	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	32.30	1.96	30.34	30.34	25.33	103.03	7.91	103.03	-117.20
10Y	26.38	1.60	24.78	24.68	21.25	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	-1.00	0.25	-1.25	-1.75	-3.25	35.50	-9.50	62.25	-9.50
KTB 2*10Y	21.50	2.10	19.40	19.50	17.30	61.50	4.10	79.50	4.10
UST 2*10Y	15.58	1.74	13.84	13.84	13.22	44.94	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	45 / 45.75	ODD Tenor	
09M	38.5		
01Y	35		
1.5Y			
02Y	23 / 23.25	SPRD	4*10y 1.75
03Y			2*10y -1.75
04Y			3*4y -0.5
05Y			6*12m -10.75
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	120 건	47	73	80	74	0	73	79
금 액	54,720 억원	27,378	27,342	31,835	21,610	0,000	33,445	22,665

장중동향

국고채 금리, 단기금리 보합세 & 장기금리 상승하며 커브 스티프닝.
금통위 전 관망세 이어져.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.
내일이 금통위임에도 전 구간 비디쉬한 모습을 보임.

CRS, 전 구간 금리 하락 마감.