IPS Daily Morning Brief

2019-09-27

종가 기준일 2019-09-26

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4725	0.50	1.4740	1.4493	1.4732	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.4075	0.25	1.4135	1.3940	1.4100	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3650	0.50	1.3690	1.3545	1.3616	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3050	0.50	1.3105	1.3014	1.2976	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2575	0.50	1.2605	1.2505	1.2433	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2275	0.50	1.2315	1.2183	1.2044	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2125	0.75	1.2160	1.2034	1.1870	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.1950	0.75	1.2005	1.1900	1.1758	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.1800	0.50	1.1900	1.1834	1.1718	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.2025	0.50	1.2140	1.2095	1.2000	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.2175	0.50	1.2290	1.2264	1.2187	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.2075	0.25	1.2210	1.2141	1.2070	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1300	0.25	1.1435	1.1381	1.1480	2.5300	0.9125	2.5600	0.9125
6*9M	-6.50	-0.25	-6.05	-5.53	-6.31	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.25	0.25	-4.45	-3.95	-4.84	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-10.75	0.00	-10.85	-10.40	-11.83	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-3.00	0.00	-2.90	-3.23	-3.89	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-4.50	0.25	-4.45	-4.71	-5.63	18.00	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-6.25	0.25	-6.00	-6.05	-6.75	22.75	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.50	0.25	-1.55	-1.49	-1.73	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.25	0.25	-3.10	-2.83	-2.86	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.75	0.00	-1.55	-1.34	-1.13	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-1.50	-0.25	-1.05	-0.66	-0.40	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	0.75	-0.25	1.35	1.95	2.43	14.00	0.50	30.25	0.50
7*10Y	2.25	0.00	2.40	2.61	2.83	7.75	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.50	0.00	1.50	1.69	1.87	4.50	1.50	6.75	-0.25
10*15Y	0.50	-0.25	0.70	0.46	0.69	6.75	-0.25	11.75	-0.75
10*20Y	-7.25	-0.25	-7.05	-7.14	-5.20	10.25	-8.00	22.75	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.342	0.00	1.336	1.287	1.288	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.370	0.00	1.376	1.323	1.298	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.340	-0.70	1.357	1.309	1.286	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.300	0.00	1.319	1.277	1.247	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.385	0.30	1.405	1.355	1.318	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.364	0.20	1.386	1.343	1.311	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.426	0.60	1.444	1.395	1.366	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.435	1.00	1.451	1.409	1.380	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.422	1.00	1.432	1.367	1.367	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.55	0.00
CALL	1.53	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.82	0.01	110.76	110.82	110.75
LKTB	133.10	-0.13	133.00	133.18	132.93

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	2.30	0.50	3.34	6.80	7.34	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-6.50	0.50	-6.55	-2.13	-0.05	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-8.25	1.20	-9.69	-5.83	-4.31	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-7.25	0.50	-8.75	-5.91	-4.28	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-17.25	0.45	-18.92	-15.18	-13.07	-4.50	-21.70	-1.45	-30.35
5Y	-16.90	0.55	-18.57	-15.31	-13.57	-3.20	-27.25	-2.25	-27.25
7Y	-24.60	-0.10	-25.42	-21.19	-19.46	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-23.25	-0.50	-23.74	-19.92	-17.95	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-29.20	-0.75	-28.87	-22.86	-21.88	1.75	-30.75	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-85.50	-14.50
-90.50	-10.00
-97.75	-9.00
-102.25	-6.50
-101.25	-2.75
-101.50	-3.25
-93.00	-3.00
-77.75	-2.50

CRS

USD/KRW 1198.80 (0.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.5100	-14.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-23.00	5.50
1.5Y	0.4000	-9.50	1.3950	1.0400	2*3Y	-7.50	2.50
2Y	0.2800	-8.50	1.3750	1.0900	2*5Y	-10.00	6.00
3Y	0.2050	-6.00	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	4.00
4Y	0.2000	-2.00	1.4600	0.0350	3*5Y	-2.50	3.50
5Y	0.1800	-2.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-2.00	-0.50
7Y	0.2500	-2.50	1.5750	0.0750	5*7Y	7.00	0.00
10Y	0.4250	-2.00	1.7900	0.2550	5*10Y	24.50	0.50

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	1.6629	-0.0196	1.6825	1.6277	1.6936	2.9773	1.4319	2.9773	0.5400
10Y	1.6983	-0.0407	1.7390	1.6508	1.7286	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	32.29	-1.26	33.55	25.77	32.36	103.03	17.69	103.03	-117.20
10Y	26.33	-5.07	31.40	18.08	25.86	98.82	8.95	98.82	-29.70

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-5.50	0.00	-5.50	-4.50	-4.00	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	9.50	1.70	7.80	10.00	10.00	63.50	4.10	79.50	4.10
UST 2*10Y	3.54	-2.11	5.65	2.31	3.50	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	30.75		
02Y	28.5 / 26.5 / 26 / 26.25	SPRD	1*2y -10
03Y	23.25		1*3y -13
04Y	21.5		4*5y -1.75
05Y	20.25 / 19.75 / 20		4*10y -0.75
07Y	18.25		5*10y 01
10Y	21		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	125 건	-23	148	62	71	103	238	160
금 액	40,415 억원	-23,859	64,274	23,630	18,342	30,435	86,350	72,640

장중동향

국고채 금리, 단기 금리 하락 & 장기 금리 상승하며 보합권 혼조 마감.

IRS, 금리 상승 마감.
현물금리에 연동된 가운데 변동성이 제한되며 조용한 장세.

CRS, 1Y을 제외한 구간에서 금리 상승.