IPS Daily Morning Brief

2019-07-25

종가 기준일 2019-07-24

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4750	-3.25	1.5205	1.6423	1.7263	1.9125	1.4750	1.9125	1.2875
9M	1.4225	-3.25	1.4660	1.5775	1.6742	1.9125	1.4225	1.9125	1.2500
1Y	1.3825	-3.00	1.4230	1.5264	1.6304	1.9200	1.3825	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3375	-2.75	1.3730	1.4650	1.5726	2.0250	1.3375	2.0250	1.1900
2Y	1.2925	-2.75	1.3255	1.4114	1.5257	2.1150	1.2925	2.1150	1.1675
3Y	1.2700	-2.50	1.2950	1.3733	1.4869	2.2225	1.2700	2.2225	1.1550
4Y	1.2650	-2.00	1.2845	1.3573	1.4713	2.2900	1.2650	2.2950	1.1575
5Y	1.2600	-2.00	1.2770	1.3464	1.4606	2.3350	1.2600	2.3400	1.1575
7Y	1.2650	-1.75	1.2795	1.3449	1.4564	2.3825	1.2650	2.3950	1.1675
10Y	1.3125	-1.25	1.3215	1.3803	1.4876	2.4475	1.3125	2.4850	1.2125
12Y	1.3325	-1.25	1.3415	1.4003	1.5108	2.4875	1.3325	2.5225	1.2150
15Y	1.3275	-1.25	1.3365	1.3945	1.5104	2.5075	1.3275	2.5400	1.2150
20Y	1.2975	-1.25	1.3065	1.3636	1.4835	2.5300	1.2975	2.6500	1.2150
6*9M	-5.25	0.00	-5.45	-6.48	-5.21	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.00	0.25	-4.30	-5.11	-4.38	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-9.00	0.25	-9.75	-11.50	-10.47	21.50	-13.50	23.00	-13.50
2*3Y	-2.25	0.25	-3.05	-3.81	-3.88	11.50	-5.00	13.25	-5.00
2*4Y	-2.75	0.75	-4.10	-5.41	-5.44	18.50	-7.75	23.50	-7.75
2*5Y	-3.25	0.75	-4.85	-6.50	-6.50	23.25	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-0.50	0.50	-1.05	-1.60	-1.57	7.50	-3.00	11.25	-3.00
3*5Y	-1.00	0.50	-1.80	-2.69	-2.63	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-0.50	0.00	-0.75	-1.09	-1.06	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	0.50	0.25	0.25	-0.15	-0.43	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	5.25	0.75	4.45	3.39	2.70	14.00	0.50	30.75	0.50
7*10Y	4.75	0.50	4.20	3.54	3.12	8.00	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.00	0.00	2.00	2.00	2.32	4.50	2.00	7.00	-0.25
10*15Y	1.50	0.00	1.50	1.43	2.28	6.75	1.25	12.50	-0.75
10*20Y	-1.50	0.00	-1.50	-1.66	-0.41	10.25	-2.00	24.25	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.336	-1.30	1.356	1.453	1.573	1.935	1.336	1.935	1.237
1.5Y	1.340	-1.60	1.364	1.458	1.573	2.113	1.340	2.113	1.232
2Y	1.337	-2.00	1.357	1.446	1.567	2.217	1.337	2.230	1.225
3Y	1.315	-2.20	1.332	1.409	1.535	2.308	1.315	2.315	1.200
4Y	1.367	-1.70	1.380	1.460	1.586	2.502	1.367	2.502	1.232
5Y	1.365	-1.70	1.375	1.450	1.572	2.592	1.365	2.602	1.217
7Y	1.439	-1.40	1.447	1.522	1.648	2.711	1.439	2.728	1.270
10Y	1.460	-1.20	1.467	1.538	1.671	2.815	1.460	2.815	1.355
20Y	1.460	-2.00	1.479	1.561	1.704	2.790	1.460	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.56	-3.00
CALL	1.48	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.79	0.06	110.71	110.82	110.71
LKTB	132.69	0.13	132.46	132.77	132.46

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	4.65	-1.70	6.72	7.38	5.74	10.45	-9.65	10.45	-17.75
1.5Y	-0.25	-1.15	0.86	0.68	-0.08	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-4.45	-0.75	-3.17	-3.44	-4.11	-0.25	-15.20	-0.25	-25.15
3Y	-4.50	-0.30	-3.72	-3.60	-4.80	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.20	-0.30	-9.51	-10.26	-11.47	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-10.50	-0.30	-9.82	-10.37	-11.17	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-17.40	-0.35	-16.75	-17.72	-19.21	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-14.75	-0.05	-14.57	-15.82	-18.30	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-16.25	0.75	-17.23	-19.70	-22.02	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-65.75	0.00
-68.25	0.25
-71.25	-0.25
-75.00	-1.00
-75.00	-1.50
-76.00	-1.50
-74.00	-1.25
-63.75	-1.75

CRS

USD/KRW 1177.90 (-1.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.7250	-3.00	1.4750	0.7250	1*2Y	-14.50	0.00
1.5Y	0.6550	-2.50	1.5250	1.0800	2*3Y	-6.00	-0.50
2Y	0.5800	-3.00	1.5650	1.1200	2*5Y	-8.00	-0.50
3Y	0.5200	-3.50	1.6550	0.5100	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	0.5150	-3.50	1.7200	0.5000	3*5Y	-2.00	0.00
5Y	0.5000	-3.50	1.7800	0.4800	4*5Y	-1.50	0.00
7Y	0.5250	-3.00	1.8950	0.5000	5*7Y	2.50	0.50
10Y	0.6750	-3.00	2.0500	0.6500	5*10Y	17.50	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	1.8214	-0.0140	1.8354	1.8227	1.8265	2.9773	1.7359	2.9773	0.4800
10Y	2.0500	-0.0306	2.0806	2.0484	2.0572	3.2382	1.9501	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	48.44	0.6	47.84	46.77	46.95	103.03	3.57	103.03	-130.00
10Y	59.00	-1.86	60.86	58.64	59.22	98.82	8.95	98.82	-47.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	2.00	1.50	0.50	-1.00	-1.25	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	12.30	0.80	11.50	10.70	10.80	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	22.86	-1.66	24.52	22.57	23.07	63.77	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	29	SPRD	1.5*4Y -07
03Y	27.25		3*4Y -01
04Y	26.75		6*7Y 0.5
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	113 건	3	110	83	118	93	151	79
금 액	41,066 억원	-2,477	43,543	39,155	47,110	30,000	57,488	21,225

장중동향

국고채 금리, 외인이 3년 국채선물을 대거 사들이면서 단기구간을 중심으로 금리 하락.

IRS, CD금리 하락 영향으로 단기구간을 중심으로 금리 하락.

CRS, 전 구간 금리 하락.