IPS Daily Morning Brief

2019-09-24

종가 기준일 2019-09-23

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4775	0.00	1.4650	1.4388	1.4839	1.9125	1.3750	1.9125	1.2875
9M	1.4200	0.00	1.4115	1.3826	1.4206	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3750	0.00	1.3710	1.3426	1.3714	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3175	0.00	1.3250	1.2856	1.3069	2.0250	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2675	0.50	1.2785	1.2325	1.2522	2.1150	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2400	0.50	1.2530	1.1975	1.2125	2.2225	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2250	0.50	1.2395	1.1820	1.1948	2.2900	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2100	0.25	1.2290	1.1689	1.1835	2.3350	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2025	0.25	1.2250	1.1629	1.1801	2.3825	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.2275	0.25	1.2525	1.1885	1.2088	2.4475	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.2425	0.25	1.2675	1.2061	1.2277	2.4875	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.2350	0.25	1.2595	1.1921	1.2161	2.5075	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1575	0.25	1.1820	1.1165	1.1596	2.5300	0.9125	2.5600	0.9125
6*9M	-5.75	0.00	-5.35	-5.61	-6.33	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-4.50	0.00	-4.05	-4.00	-4.92	8.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-10.75	0.50	-9.25	-11.01	-11.93	20.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-2.75	0.00	-2.55	-3.50	-3.97	10.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-4.25	0.00	-3.90	-5.05	-5.73	18.00	-8.25	23.50	-8.25
2*5Y	-5.75	-0.25	-4.95	-6.36	-6.87	22.75	-10.00	34.00	-10.00
3*4Y	-1.50	0.00	-1.35	-1.55	-1.76	7.50	-3.25	11.25	-3.25
3*5Y	-3.00	-0.25	-2.40	-2.86	-2.90	12.50	-5.25	22.00	-5.25
4*5Y	-1.50	-0.25	-1.05	-1.31	-1.13	5.25	-2.25	10.75	-2.25
5*7Y	-0.75	0.00	-0.40	-0.60	-0.34	6.25	-1.75	14.75	-1.75
5*10Y	1.75	0.00	2.35	1.96	2.53	14.00	0.50	30.25	0.50
7*10Y	2.50	0.00	2.75	2.56	2.87	7.75	1.75	15.75	1.75
10*12Y	1.50	0.00	1.50	1.76	1.89	4.50	1.50	6.75	-0.25
10*15Y	0.75	0.00	0.70	0.36	0.73	6.75	-0.25	12.00	-0.75
10*20Y	-7.00	0.00	-7.05	-7.20	-4.92	10.25	-8.00	23.00	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.332	0.20	1.320	1.261	1.297	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.380	0.00	1.370	1.295	1.305	2.113	1.122	2.113	1.122
2Y	1.370	1.00	1.353	1.285	1.293	2.212	1.089	2.230	1.089
3Y	1.335	1.00	1.322	1.256	1.253	2.308	0.092	2.315	0.092
4Y	1.422	0.70	1.415	1.328	1.322	2.486	1.127	2.502	1.127
5Y	1.405	1.00	1.395	1.318	1.316	2.592	1.122	2.602	1.122
7Y	1.462	1.10	1.457	1.366	1.371	2.711	1.163	2.728	1.163
10Y	1.470	1.30	1.468	1.379	1.384	2.815	1.170	2.815	1.170
20Y	1.455	3.80	1.426	1.341	1.374	2.790	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.55	0.00
CALL	1.51	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.69	-0.02	110.75	110.77	110.67
LKTB	132.76	-0.12	133.04	133.11	132.73

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	4.30	-0.20	5.10	8.14	7.48	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-6.25	0.00	-4.50	-0.95	0.17	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-10.25	-0.50	-7.49	-5.28	-4.08	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-9.50	-0.50	-6.92	-5.87	-4.08	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-19.70	-0.20	-17.53	-14.55	-12.73	-4.50	-21.70	-1.45	-30.35
5Y	-19.50	-0.75	-16.64	-14.91	-13.24	-3.20	-27.25	-2.25	-27.25
7Y	-25.95	-0.85	-23.24	-20.28	-19.11	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-24.25	-1.05	-21.57	-19.06	-17.57	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-29.75	-3.55	-24.40	-22.42	-21.46	1.75	-29.75	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-72.50	1.00
-82.25	1.00
-89.75	0.50
-97.00	0.50
-100.00	0.00
-100.50	0.25
-92.75	0.25
-77.75	0.25

CRS

USD/KRW 1194.00 (+6.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.6500	1.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-28.00	0.00
1.5Y	0.4950	1.00	1.3950	1.0400	2*3Y	-10.00	0.00
2Y	0.3700	1.00	1.3750	1.0900	2*5Y	-16.50	-0.50
3Y	0.2700	1.00	1.4100	0.0450	3*4Y	-4.50	-0.50
4Y	0.2250	0.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-6.50	-0.50
5Y	0.2050	0.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-2.00	0.00
7Y	0.2750	0.50	1.5750	0.0750	5*7Y	7.00	0.00
10Y	0.4500	0.50	1.7900	0.2550	5*10Y	24.50	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	1.6936	0.0126	1.6810	1.7419	1.7580	2.9773	1.4319	2.9773	0.5400
10Y	1.7286	0.0053	1.7233	1.7849	1.7971	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	32.36	0.26	32.10	38.69	42.10	103.03	17.69	103.03	-117.20
10Y	25.86	-0.77	26.63	31.99	34.01	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	-4.00	-0.25	-3.75	-2.25	-2.25	35.75	-9.50	62.75	-9.50
KTB 2*10Y	10.00	0.30	9.70	11.00	12.00	63.50	4.10	82.90	4.10
UST 2*10Y	3.50	-0.73	4.23	4.30	3.91	54.43	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	47.5	ODD Tenor	
09M			
01Y	31.5		
1.5Y	31.75		
02Y	26	SPRD	
03Y	23.25		
04Y			
05Y	20.5/21		
07Y			
10Y	22.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	71 건	-32	103	238	160	118	133	0
금 액	18,342 억원	-12,093	30,435	86,350	72,640	35,269	36,640	0,000

장중동향

채권은 미국채의 영향으로 상승 출발했으나 시장 참가자들의 매매심리가 식으면서 하락하며 대부분 구간에서 금리상승 마감.

IRS도 대부분 테너 상승. 장중 ND오퍼와 청산 비드로 대치하며 비드가 우세한 분위기.

CRS도 전 구간 상승 마감.