IPS Daily Morning Brief

2019-10-28

종가 기준일 2019-10-25

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4075	1.00	1.3795	1.4260	1.4243	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.3950	1.25	1.3665	1.3783	1.3659	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3825	2.00	1.3475	1.3418	1.3208	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3625	2.75	1.3260	1.2950	1.2609	1.9775	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3375	3.50	1.2995	1.2559	1.2109	2.0450	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3300	3.75	1.2990	1.2361	1.1770	2.1400	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3300	3.50	1.3070	1.2320	1.1633	2.2050	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3325	3.25	1.3145	1.2290	1.1538	2.2575	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3350	3.25	1.3225	1.2258	1.1485	2.3125	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3725	3.25	1.3610	1.2553	1.1741	2.3850	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3875	3.50	1.3770	1.2698	1.1908	2.4250	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3825	3.75	1.3710	1.2608	1.1779	2.4525	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3125	3.75	1.2985	1.1845	1.1036	2.4825	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-1.25	0.25	-1.30	-4.78	-5.85	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-1.25	0.75	-1.90	-3.65	-4.50	5.75	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-4.50	1.50	-4.80	-8.59	-11.00	17.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-0.75	0.25	-0.05	-1.98	-3.39	10.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-0.75	0.00	0.75	-2.39	-4.76	17.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-0.50	-0.25	1.50	-2.69	-5.70	22.75	-10.00	27.50	-10.00
3*4Y	0.00	-0.25	0.80	-0.41	-1.37	7.25	-3.25	9.50	-3.25
3*5Y	0.25	-0.50	1.55	-0.71	-2.31	12.25	-5.25	18.75	-5.25
4*5Y	0.25	-0.25	0.75	-0.30	-0.95	5.25	-2.25	9.75	-2.25
5*7Y	0.25	0.00	0.80	-0.32	-0.53	5.50	-1.75	14.00	-1.75
5*10Y	4.00	0.00	4.65	2.63	2.03	12.75	0.50	29.50	0.50
7*10Y	3.75	0.00	3.85	2.95	2.55	7.50	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.50	0.25	1.60	1.45	1.68	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	1.00	0.50	1.00	0.55	0.38	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-6.00	0.50	-6.25	-7.08	-7.05	10.25	-8.00	16.75	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.380	3.40	1.339	1.309	1.262	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.420	2.80	1.386	1.330	1.278	2.049	1.122	2.113	1.122
2Y	1.432	3.80	1.389	1.323	1.266	2.140	1.089	2.230	1.089
3Y	1.445	4.80	1.401	1.318	1.233	2.225	0.092	2.315	0.092
4Y	1.538	4.50	1.498	1.399	1.316	2.412	1.127	2.502	1.127
5Y	1.545	4.80	1.506	1.393	1.309	2.522	1.122	2.602	1.122
7Y	1.649	4.80	1.615	1.491	1.375	2.646	1.163	2.728	1.163
10Y	1.685	4.80	1.656	1.524	1.393	2.752	1.170	2.815	1.170
20Y	1.687	3.50	1.663	1.515	1.375	2.732	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.37	0.00
CALL	1.23	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.23	-0.15	110.38	1110.40	110.23
LKTB	130.30	-0.46	130.67	130.74	130.25

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	0.25	-1.40	0.81	3.26	5.92	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-5.75	-0.05	-5.98	-3.50	-1.67	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-9.45	-0.30	-8.95	-6.76	-5.48	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-11.50	-1.05	-10.18	-8.22	-5.65	92.30	-12.20	92.30	-19.50
4Y	-20.80	-1.00	-19.10	-16.69	-15.28	-4.50	-20.85	-1.45	-30.35
5Y	-21.25	-1.55	-19.17	-16.39	-15.57	-3.20	-26.75	-2.25	-27.25
7Y	-31.40	-1.55	-29.23	-26.51	-22.61	-7.85	-34.75	-7.50	-37.65
10Y	-31.25	-1.55	-29.50	-26.87	-21.91	-7.50	-36.70	-7.50	-38.70
20Y	-37.45	0.25	-36.45	-33.09	-27.13	1.75	-38.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-67.25	-1.50
-73.25	-1.25
-76.75	-1.00
-77.50	-1.25
-77.50	-0.50
-78.75	-0.75
-72.50	-0.75
-59.75	-0.75

CRS

USD/KRW 1173.00 (+0.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.7100	0.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-14.00	2.00
1.5Y	0.6300	1.50	1.3950	1.1000	2*3Y	-1.50	0.00
2Y	0.5700	2.50	1.3750	1.1550	2*5Y	-2.50	0.00
3Y	0.5550	2.50	1.4100	0.0450	3*4Y	0.00	0.50
4Y	0.5550	3.00	1.4600	0.0350	3*5Y	-1.00	0.00
5Y	0.5450	2.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-1.00	-0.50
7Y	0.6100	2.50	1.5750	0.0750	5*7Y	6.50	0.00
10Y	0.7750	2.50	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	1.6350	0.0638	1.5712	1.5750	1.6026	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.7962	0.0283	1.7679	1.7688	1.7670	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	20.30	2.58	17.72	20.30	24.26	103.03	7.91	103.03	-108.00
10Y	11.12	-1.97	13.09	12.68	12.00	98.82	3.89	98.82	-26.00

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	3.50	-0.25	3.75	6.75	8.75	35.50	-9.50	56.50	-9.50
KTB 2*10Y	25.30	1.00	24.30	27.00	28.70	61.30	4.10	74.80	4.10
UST 2*10Y	16.12	-3.55	19.67	19.38	16.44	44.62	-23.40	166.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6y 32.5
06M			
09M			
01Y	36.75 / 37 / 38		
1.5Y			
02Y		SPRD	10*12y 1.5
03Y	30		5*12y 5.5
04Y			
05Y	31.25 / 32		
07Y			
10Y			
12Y	38		
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	128 건	-32	160	157	118	96	195	191
금 액	36,496 억원	-34,729	71,225	42,535	39,425	35,375	76,587	80,447

장중동향

국고채 금리, 외인의 현선물 매도에 금리 상승 마감.

IRS, 국채선물 등락에 맞춰 거래되며 금리 상승 마감.

CRS, 전 구간 금리 상승.