# IPS Daily Morning Brief

**2019-11-04**

종가 기준일 2019-11-01

## IRS

| Tenor | Lv. | 전일비 | 5MA | 20MA | 60MA | 1Y Max | 1Y Min | 3Y Max | 3Y Min |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 6M | 1.4350 | 1.50 | 1.4320 | 1.4173 | 1.4273 | 1.9125 | 1.3575 | 1.9125 | 1.2875 |
| 9M | 1.4200 | 1.50 | 1.4230 | 1.3845 | 1.3740 | 1.9125 | 1.2925 | 1.9125 | 1.2500 |
| 1Y | 1.4000 | 1.50 | 1.4095 | 1.3563 | 1.3328 | 1.9200 | 1.2225 | 1.9200 | 1.2200 |
| 1.5Y | 1.3775 | 1.25 | 1.3875 | 1.3198 | 1.2777 | 1.9775 | 1.1350 | 2.0250 | 1.1350 |
| 2Y | 1.3500 | 1.00 | 1.3620 | 1.2851 | 1.2306 | 2.0450 | 1.0700 | 2.1150 | 1.0700 |
| 3Y | 1.3425 | 0.50 | 1.3620 | 1.2729 | 1.2009 | 2.1400 | 1.0150 | 2.2225 | 1.0150 |
| 4Y | 1.3400 | 0.00 | 1.3640 | 1.2716 | 1.1895 | 2.2050 | 0.9875 | 2.2950 | 0.9875 |
| 5Y | 1.3400 | -0.25 | 1.3665 | 1.2715 | 1.1813 | 2.2475 | 0.9775 | 2.3400 | 0.9775 |
| 7Y | 1.3400 | -0.25 | 1.3675 | 1.2708 | 1.1764 | 2.2950 | 0.9725 | 2.3950 | 0.9725 |
| 10Y | 1.3675 | -0.75 | 1.4005 | 1.3020 | 1.2030 | 2.3650 | 0.9925 | 2.4850 | 0.9925 |
| 12Y | 1.3825 | -0.75 | 1.4145 | 1.3164 | 1.2195 | 2.4050 | 1.0125 | 2.5225 | 1.0125 |
| 15Y | 1.3800 | -0.75 | 1.4120 | 1.3093 | 1.2076 | 2.4325 | 0.9925 | 2.5400 | 0.9925 |
| 20Y | 1.3100 | -0.75 | 1.3420 | 1.2349 | 1.1320 | 2.4625 | 0.9125 | 2.5600 | 0.9125 |
| 6*9M | -1.50 | 0.00 | -0.90 | -3.28 | -5.33 | 8.50 | -9.00 | 12.50 | -9.00 |
| 9*12M | -2.00 | 0.00 | -1.35 | -2.83 | -4.12 | 5.50 | -7.00 | 10.50 | -7.00 |
| 1*2Y | -5.00 | -0.50 | -4.75 | -7.11 | -10.22 | 16.50 | -15.50 | 23.00 | -15.50 |
| 2*3Y | -0.75 | -0.50 | 0.00 | -1.23 | -2.98 | 10.00 | -5.50 | 13.25 | -5.50 |
| 2*4Y | -1.00 | -1.00 | 0.20 | -1.35 | -4.11 | 17.00 | -8.25 | 21.75 | -8.25 |
| 2*5Y | -1.00 | -1.25 | 0.45 | -1.36 | -4.93 | 22.00 | -10.00 | 27.50 | -10.00 |
| 3*4Y | -0.25 | -0.50 | 0.20 | -0.13 | -1.13 | 7.00 | -3.25 | 9.50 | -3.25 |
| 3*5Y | -0.25 | -0.75 | 0.45 | -0.14 | -1.96 | 12.00 | -5.25 | 18.75 | -5.25 |
| 4*5Y | 0.00 | -0.25 | 0.25 | -0.01 | -0.83 | 5.00 | -2.25 | 9.25 | -2.25 |
| 5*7Y | 0.00 | 0.00 | 0.10 | -0.07 | -0.49 | 5.25 | -1.75 | 14.00 | -1.75 |
| 5*10Y | 2.75 | -0.50 | 3.40 | 3.05 | 2.18 | 12.50 | 0.50 | 29.50 | 0.50 |
| 7*10Y | 2.75 | -0.50 | 3.30 | 3.13 | 2.66 | 7.50 | 1.75 | 15.50 | 1.75 |
| 10*12Y | 1.50 | 0.00 | 1.40 | 1.44 | 1.65 | 4.00 | 1.25 | 6.75 | -0.25 |
| 10*15Y | 1.25 | 0.00 | 1.15 | 0.72 | 0.45 | 6.75 | -0.25 | 11.25 | -0.75 |
| 10*20Y | -5.75 | 0.00 | -5.85 | -6.71 | -7.11 | 10.25 | -8.00 | 16.75 | -11.00 |

## BOND

| Tenor | Lv. | 전일비 | 5MA | 20MA | 60MA | 1Y Max | 1Y Min | 3Y Max | 3Y Min |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1Y | 0.000 | -140.50 | 1.413 | 1.330 | 1.275 | 1.918 | 1.136 | 1.935 | 1.136 |
| 1.5Y | 0.000 | -144.50 | 1.457 | 1.360 | 1.296 | 2.049 | 1.122 | 2.113 | 1.122 |
| 2Y | 0.000 | -145.00 | 1.469 | 1.359 | 1.287 | 2.137 | 1.089 | 2.230 | 1.089 |
| 3Y | 0.000 | -146.20 | 1.487 | 1.363 | 1.256 | 2.225 | 0.092 | 2.315 | 0.092 |
| 4Y | 0.000 | -157.10 | 1.593 | 1.450 | 1.345 | 2.392 | 1.127 | 2.502 | 1.127 |
| 5Y | 0.000 | -158.60 | 1.605 | 1.451 | 1.339 | 2.500 | 1.122 | 2.602 | 1.122 |
| 7Y | 0.000 | -169.10 | 1.713 | 1.553 | 1.408 | 2.630 | 1.163 | 2.728 | 1.163 |
| 10Y | 0.000 | -173.00 | 1.754 | 1.588 | 1.429 | 2.715 | 1.170 | 2.815 | 1.170 |
| 20Y | 0.000 | -171.00 | 1.741 | 1.581 | 1.410 | 2.704 | 1.146 | 2.792 | 1.146 |

| 기타금리 | Lv. | 전일비 |
|---|---|---|
| 91d CD | 1.44 | 0.00 |
| CALL | 1.25 | -3.00 |

| 국채선물 | Lv. | 전일비 | 시 | 고 | 저 |
|---|---|---|---|---|---|
| KTB | 110.11 | -0.02 | 110.20 | 110.23 | 110.10 |
| LKTB | 129.72 | -0.07 | 130.08 | 130.27 | 129.63 |

## 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 | 140.00 | 142.00 | 27.95 | 9.30 | 7.94 | 140.00 | -9.65 | 140.00 | -17.75 |
| 1.5Y | 137.75 | 145.75 | 22.17 | 2.74 | 0.31 | 137.75 | -10.60 | 137.75 | -19.10 |
| 2Y | 135.00 | 146.00 | 18.70 | -0.62 | -3.46 | 135.00 | -12.75 | 135.00 | -25.15 |
| 3Y | 134.25 | 146.70 | 17.28 | -2.20 | -3.46 | 134.25 | -12.45 | 134.25 | -19.50 |
| 4Y | 134.00 | 157.10 | 8.98 | -10.62 | -13.34 | 134.00 | -23.10 | 134.00 | -30.35 |
| 5Y | 134.00 | 158.35 | 8.29 | -10.70 | -13.57 | 134.00 | -26.50 | 134.00 | -27.25 |
| 7Y | 134.00 | 168.85 | -0.25 | -20.43 | -20.82 | 134.00 | -34.85 | 134.00 | -37.65 |
| 10Y | 136.75 | 172.25 | -0.27 | -20.67 | -20.21 | 136.75 | -36.55 | 136.75 | -38.70 |
| 20Y | 131.00 | 170.25 | -5.10 | -26.74 | -25.45 | 131.00 | -39.55 | 131.00 | -48.50 |

## BASIS SWAP

| Lv. | 전일비 |
|---|---|
| -64.50 | -3.50 |
| -64.75 | -3.25 |
| -65.00 | -2.00 |
| -65.25 | -1.50 |
| -66.00 | -1.00 |
| -67.50 | -0.75 |
| -62.00 | -1.75 |
| -49.25 | -2.25 |

## CRS

USD/KRW 1165.60 (+2.20)

| Tenor | Lv. | 전일비 | 1Y Max | 1Y Min | SPRD | Lv. | 전일비 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1Y | 0.7550 | -2.00 | 1.4550 | 0.3900 | 1*2Y | -5.50 | 1.00 |
| 1.5Y | 0.7300 | -2.00 | 1.3950 | 1.1250 | 2*3Y | -1.00 | 0.00 |
| 2Y | 0.7000 | -1.00 | 1.3750 | 1.1550 | 2*5Y | -3.50 | 0.00 |
| 3Y | 0.6900 | -1.00 | 1.4100 | 0.0450 | 3*4Y | -1.00 | 0.00 |
| 4Y | 0.6800 | -1.00 | 1.4600 | 0.0350 | 3*5Y | -2.50 | 0.00 |
| 5Y | 0.6650 | -1.00 | 1.5300 | 0.0150 | 4*5Y | -1.50 | 0.00 |
| 7Y | 0.7200 | -2.00 | 1.5750 | 0.0750 | 5*7Y | 5.50 | -1.00 |
| 10Y | 0.8750 | -3.00 | 1.7800 | 0.2550 | 5*10Y | 21.00 | -2.00 |

## 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 | 1.5600 | 0.0321 | 1.5279 | 1.5996 | 1.6473 | 2.9773 | 1.3841 | 2.9773 | 0.5500 |
| 10Y | 1.7156 | 0.0262 | 1.6894 | 1.7769 | 1.8386 | 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 | 156.00 | 148.21 | 7.79 | 14.46 | 18.23 | 156.00 | 7.79 | 156.00 | -108.00 |
| 10Y | 171.56 | 175.62 | -4.06 | 3.39 | 7.26 | 171.56 | -4.06 | 171.56 | -26.00 |

| SPRD | Lv. | 전일비 | T-1 | T-2 | T-3 | 1Y Max | 1Y Min | 3Y Max | 3Y Min |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IRS 2*10Y | 1.75 | -1.75 | 3.50 | 5.00 | 5.00 | 34.50 | -9.50 | 56.50 | -9.50 |
| KTB 2*10Y | 0.00 | -28.00 | 28.00 | 28.80 | 30.10 | 60.30 | 0.00 | 74.30 | 0.00 |
| UST 2*10Y | 15.56 | -0.59 | 16.15 | 17.73 | 19.13 | 40.13 | -23.40 | 159.00 | -23.40 |

## TODAY MARKET DEAL LEVEL

| | | | |
|---|---|---|---|
| IRS | | | |
| 06M | | ODD Tenor | |
| 09M | | | |
| 01Y | | | |
| 1.5Y | | | |
| 02Y | | SPRD | 2*4y -0.5 |
| 03Y | | | |
| 04Y | 31.25 / 33 | | |
| 05Y | 31.5 / 33 / 33.25 / 33.5 | | |
| 07Y | 32.5 | | |
| 10Y | | | |
| 12Y | | | |
| 15Y | | | |
| 20Y | | | |
| CRS | | | |

| TODAY KRX CCP | 전일비 | T-1 | T-2 | T-3 | T-4 | T-5 | T-6 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 거래현황 | 124 건 | -9 | 133 | 81 | 122 | 142 | 128 | 160 |
| 금 액 | 49,280 억원 | -5,431 | 54,711 | 23,695 | 37,865 | 59,940 | 36,496 | 71,225 |

## 장중동향

국고채 금리, 개인 국채선물 매도 등 수급 불안 심리가 작용하며 금리 상승 마감.

IRS, 단기 구간 금리 상승, 중단기 구간 금리 하락 혼조 마감.

CRS, 전 구간 금리 하락.