

IPS Daily Morning Brief

2019-11-06

종가 기준일 2019-11-05

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4800	1.75	1.4445	1.4186	1.4298	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4575	0.25	1.4305	1.3920	1.3783	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4350	-0.75	1.4120	1.3674	1.3386	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4150	-1.75	1.3925	1.3363	1.2856	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3950	-2.25	1.3690	1.3051	1.2400	2.0200	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3925	-2.00	1.3665	1.2960	1.2118	2.1100	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3950	-2.00	1.3685	1.2965	1.2012	2.1750	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.4000	-2.00	1.3715	1.2980	1.1935	2.2150	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.4025	-2.00	1.3730	1.2988	1.1888	2.2600	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.4300	-2.00	1.4030	1.3303	1.2157	2.3300	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4475	-1.75	1.4185	1.3450	1.2321	2.3700	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.4425	-2.00	1.4155	1.3385	1.2206	2.3975	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3650	-2.00	1.3425	1.2641	1.1449	2.4275	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-2.25	-1.50	-1.40	-2.66	-5.15	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.25	-1.00	-1.85	-2.46	-3.98	5.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-4.00	-1.50	-4.30	-6.23	-9.85	15.00	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-0.25	0.25	-0.25	-0.91	-2.83	9.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	0.00	0.25	-0.05	-0.86	-3.88	15.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	0.50	0.25	0.25	-0.71	-4.65	19.50	-10.00	27.50	-10.00
3*4Y	0.25	0.00	0.20	0.05	-1.06	6.50	-3.25	9.50	-3.25
3*5Y	0.75	0.00	0.50	0.20	-1.83	11.00	-5.25	18.75	-5.25
4*5Y	0.50	0.00	0.30	0.15	-0.77	5.00	-2.25	9.25	-2.25
5*7Y	0.25	0.00	0.15	0.08	-0.47	5.25	-1.75	14.00	-1.75
5*10Y	3.00	0.00	3.15	3.23	2.22	12.25	0.50	29.50	0.50
7*10Y	2.75	0.00	3.00	3.15	2.69	7.50	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.75	0.25	1.55	1.48	1.64	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	1.25	0.00	1.25	0.82	0.49	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-6.50	0.00	-6.05	-6.61	-7.08	10.25	-8.00	16.75	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.416	0.00	1.409	1.347	1.284	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.485	0.00	1.463	1.386	1.309	2.039	1.122	2.113	1.122
2Y	1.510	0.00	1.475	1.389	1.301	2.120	1.089	2.230	1.089
3Y	1.557	0.00	1.504	1.400	1.273	2.192	0.092	2.315	0.092
4Y	1.665	0.00	1.612	1.492	1.365	2.365	1.127	2.502	1.127
5Y	1.685	0.00	1.630	1.498	1.360	2.472	1.122	2.602	1.122
7Y	1.786	0.00	1.733	1.601	1.431	2.600	1.163	2.728	1.163
10Y	1.837	0.00	1.777	1.639	1.454	2.677	1.170	2.815	1.170
20Y	1.795	0.00	1.747	1.627	1.433	2.670	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.49	3.00
CALL	1.25	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.96	0.14	109.80	109.96	109.64
LKTb	128.81	0.21	128.45	128.84	127.82

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.90	-0.75	0.26	2.05	5.47	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-7.00	-1.75	-7.03	-4.93	-2.33	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-11.50	-2.25	-10.64	-8.34	-6.11	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-16.45	-2.00	-13.75	-10.36	-6.15	92.30	-16.45	92.30	-19.50
4Y	-27.00	-2.00	-24.37	-19.59	-16.38	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-28.50	-2.00	-25.81	-19.99	-16.65	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-38.35	-2.00	-36.02	-30.18	-24.23	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-40.70	-2.00	-37.44	-30.83	-23.80	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-43.00	-2.00	-40.49	-36.30	-28.85	1.75	-43.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1157.50 (-1.75)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-58.50	5.25	1Y	0.8500	4.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-5.00	0.50	
-58.50	6.75	1.5Y	0.8300	5.00	1.3950	1.1250	2*3Y	-0.50	0.00	
-59.50	7.25	2Y	0.8000	5.00	1.3750	1.1550	2*5Y	-2.00	0.50	
-59.75	7.00	3Y	0.7950	5.00	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	0.50	
-60.50	7.50	4Y	0.7900	5.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-1.50	0.50	
-62.00	7.50	5Y	0.7800	5.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-1.00	0.00	
-57.25	7.00	7Y	0.8300	5.00	1.5750	0.0750	5*7Y	5.00	-0.50	
-44.50	7.00	10Y	0.9850	5.00	1.7800	0.2550	5*10Y	20.50	-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	1.6285	0.0483	1.5802	1.5600	1.5279	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.8621	0.0832	1.7789	1.7156	1.6894	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	11.85	4.83	7.02	10.80	7.79	103.03	7.02	103.03	-108.00
10Y	2.51	8.32	-5.81	-2.44	-4.06	98.82	-5.81	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	3.25	1.75	3.50	31.00	-9.50	56.50	-9.50
KTb 2*10Y	32.70	0.00	32.70	28.80	28.00	55.70	4.10	74.30	4.10
UST 2*10Y	23.36	3.49	19.87	15.56	16.15	37.15	-23.40	159.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	46.5								
1.5Y									
02Y		SPRD	3*4y 0.25						
03Y	41.5		12*20y -8.25						
04Y									
05Y	46.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	129 건	51	78	124	133	81	122	142	
금 액	35,310 억원	12,896	22,414	49,280	54,711	23,695	37,865	59,940	

장중동향
국고채 금리, 고점 인식에 따른 매수세 유입되며 강세로 금리 하락 마감.

IRS, 1Y 이상 구간에서 금리 하락하며 혼조 마감. CD 금리 이틀째 상승.
장중 채권시장 변동성이 커지며 이에 연동.

CRS, 금리 상승 마감.