IPS Daily Morning Brief

2019-11-07

종가 기준일 2019-11-06

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4900	1.00	1.4575	1.4201	1.4314	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4675	1.00	1.4410	1.3961	1.3807	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4475	1.25	1.4220	1.3731	1.3417	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4250	1.00	1.4030	1.3441	1.2897	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.4050	1.00	1.3815	1.3145	1.2448	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.4025	1.00	1.3775	1.3070	1.2174	2.0950	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.4050	1.00	1.3790	1.3084	1.2072	2.1575	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.4150	1.50	1.3835	1.3109	1.1998	2.1950	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.4200	1.75	1.3855	1.3125	1.1953	2.2350	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.4500	2.00	1.4145	1.3443	1.2223	2.3050	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4675	2.00	1.4305	1.3593	1.2387	2.3450	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.4625	2.00	1.4270	1.3530	1.2274	2.3725	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3725	0.75	1.3500	1.2780	1.1513	2.4025	0.9125	2.5600	0.9125
6*9M	-2.25	0.00	-1.65	-2.40	-5.07	8.50	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.00	0.25	-1.90	-2.30	-3.90	5.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-4.25	-0.25	-4.05	-5.86	-9.68	15.00	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-0.25	0.00	-0.40	-0.75	-2.75	8.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	0.00	0.00	-0.25	-0.61	-3.76	14.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	1.00	0.50	0.20	-0.36	-4.50	18.50	-10.00	27.50	-10.00
3*4Y	0.25	0.00	0.15	0.14	-1.02	6.25	-3.25	9.50	-3.25
3*5Y	1.25	0.50	0.60	0.39	-1.75	11.00	-5.25	18.75	-5.25
4*5Y	1.00	0.50	0.45	0.25	-0.74	5.00	-2.25	9.25	-2.25
5*7Y	0.50	0.25	0.20	0.16	-0.45	5.25	-1.75	13.50	-1.75
5*10Y	3.50	0.50	3.10	3.34	2.25	12.25	0.50	29.00	0.50
7*10Y	3.00	0.25	2.90	3.18	2.70	7.50	1.75	15.50	1.75
10*12Y	1.75	0.00	1.60	1.50	1.64	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	1.25	0.00	1.25	0.87	0.51	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-7.75	-1.25	-6.45	-6.63	-7.10	10.25	-8.00	16.75	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.406	-1.00	1.410	1.353	1.287	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.470	-1.50	1.467	1.395	1.314	2.036	1.122	2.113	1.122
2Y	1.490	-2.00	1.482	1.399	1.307	2.112	1.089	2.230	1.089
3Y	1.520	-3.70	1.515	1.413	1.280	2.177	0.092	2.315	0.092
4Y	1.633	-3.20	1.624	1.508	1.373	2.352	1.127	2.502	1.127
5Y	1.657	-2.80	1.644	1.515	1.368	2.451	1.122	2.602	1.122
7Y	1.756	-3.00	1.745	1.618	1.440	2.576	1.163	2.728	1.163
10Y	1.810	-2.70	1.791	1.658	1.463	2.651	1.170	2.815	1.170
20Y	1.780	-1.50	1.758	1.645	1.443	2.640	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.50	1.00
CALL	1.23	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.97	0.01	109.88	109.97	109.72
LKTB	128.89	0.08	128.45	128.89	128.19

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	4.15	2.25	1.24	2.03	5.42	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-4.50	2.50	-6.42	-5.05	-2.42	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-8.50	3.00	-10.09	-8.48	-6.21	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-11.75	4.70	-13.71	-10.56	-6.22	92.30	-16.45	92.30	-19.50
4Y	-22.80	4.20	-24.48	-19.96	-16.54	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-24.20	4.30	-26.01	-20.46	-16.82	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-33.60	4.75	-35.91	-30.60	-24.48	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-36.00	4.70	-37.63	-31.37	-24.11	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-40.75	2.25	-40.84	-36.73	-29.16	1.75	-43.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-55.25	3.25
-55.00	3.50
-56.00	3.50
-56.25	3.50
-57.00	3.50
-59.00	3.00
-54.50	2.75
-42.00	2.50

CRS

USD/KRW 1156.90 (-0.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8950	4.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-5.00	0.00
1.5Y	0.8750	4.50	1.3950	1.1250	2*3Y	-0.50	0.00
2Y	0.8450	4.50	1.3750	1.1550	2*5Y	-2.00	0.00
3Y	0.8400	4.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	0.8350	4.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-1.50	0.00
5Y	0.8250	4.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-1.00	0.00
7Y	0.8750	4.50	1.5750	0.0750	5*7Y	5.00	0.00
10Y	1.0300	4.50	1.7800	0.2550	5*10Y	20.50	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	1.6126	-0.0159	1.6285	1.5802	1.5600	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.8320	-0.0301	1.8621	1.7789	1.7156	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	12.26	0.41	11.85	7.02	10.80	103.03	7.02	103.03	-108.00
10Y	2.20	-0.31	2.51	-5.81	-2.44	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	4.50	1.00	3.50	3.25	1.75	29.50	-9.50	56.50	-9.50
KTB 2*10Y	32.00	-0.70	32.70	32.70	28.80	55.50	4.10	74.30	4.10
UST 2*10Y	21.94	-1.42	23.36	19.87	15.56	37.15	-23.40	154.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	44	SPRD	
03Y	40.75		
04Y	42		
05Y	41.5 / 43 / 43.5 / 46		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3y CCS 83		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	139 건	10	129	78	124	133	81	122
금 액	44,908 억원	9,598	35,310	22,414	49,280	54,711	23,695	37,865

장중동향

국고채 금리, 소폭 상승 마감.
채권 현물과 선물 가격이 다소 괴리되는 모습.

IRS, 전 구간 금리 상승 마감.
국채선물에 연동되며 변동성이 큰 모습.

CRS, 전 구간 금리 상승.