IPS Daily Morning Brief

2019-11-11

종가 기준일 2019-11-08

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4975	-2.75	1.4910	1.4260	1.4356	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4725	-3.25	1.4715	1.4066	1.3867	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4550	-3.25	1.4535	1.3869	1.3493	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4300	-4.00	1.4345	1.3624	1.2995	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.4150	-4.00	1.4175	1.3361	1.2562	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.4275	-3.00	1.4185	1.3323	1.2308	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.4325	-2.75	1.4215	1.3349	1.2215	2.1325	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.4400	-2.50	1.4280	1.3386	1.2147	2.1700	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.4425	-2.75	1.4315	1.3414	1.2104	2.2100	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.4750	-3.00	1.4620	1.3739	1.2378	2.2750	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4925	-3.00	1.4790	1.3894	1.2541	2.3150	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.4875	-3.00	1.4745	1.3836	1.2433	2.3425	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3875	-3.00	1.3855	1.3064	1.1665	2.3775	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-2.50	-0.50	-1.95	-1.94	-4.89	8.25	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-1.75	0.00	-1.80	-1.98	-3.74	5.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-4.00	-0.75	-3.60	-5.08	-9.31	14.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	1.25	1.00	0.10	-0.39	-2.55	8.25	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	1.75	1.25	0.40	-0.13	-3.47	13.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	2.50	1.50	1.05	0.25	-4.15	18.00	-10.00	27.50	-10.00
3*4Y	0.50	0.25	0.30	0.26	-0.92	6.00	-3.25	9.25	-3.25
3*5Y	1.25	0.50	0.95	0.64	-1.60	11.00	-5.25	18.50	-5.25
4*5Y	0.75	0.25	0.65	0.38	-0.68	5.00	-2.25	9.25	-2.25
5*7Y	0.25	-0.25	0.35	0.27	-0.43	5.25	-1.75	12.50	-1.75
5*10Y	3.50	-0.50	3.40	3.53	2.31	12.25	0.50	27.25	0.50
7*10Y	3.25	-0.25	3.05	3.25	2.74	7.50	1.75	14.75	1.75
10*12Y	1.75	0.00	1.70	1.55	1.63	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	1.25	0.00	1.25	0.97	0.55	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-8.75	0.00	-7.65	-6.75	-7.14	10.25	-8.75	16.75	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.410	-0.10	1.412	1.364	1.295	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.471	-0.90	1.478	1.412	1.325	2.036	1.122	2.113	1.122
2Y	1.495	-2.00	1.504	1.421	1.320	2.100	1.089	2.230	1.089
3Y	1.515	-3.50	1.540	1.438	1.310	2.160	0.092	2.315	0.092
4Y	1.621	-3.40	1.648	1.537	1.389	2.310	1.127	2.502	1.127
5Y	1.640	-3.50	1.668	1.547	1.385	2.407	1.122	2.602	1.122
7Y	1.743	-3.40	1.770	1.650	1.459	2.536	1.163	2.728	1.163
10Y	1.800	-3.20	1.823	1.692	1.484	2.612	1.170	2.815	1.170
20Y	1.775	-1.50	1.787	1.677	1.463	2.607	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.52	0.00
CALL	1.28	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.97	0.10	109.67	109.99	109.64
LKTB	128.98	0.32	127.82	129.10	127.73

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	4.50	-3.15	4.17	2.25	5.38	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-4.10	-3.10	-4.37	-4.94	-2.55	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-8.00	-2.00	-8.65	-8.48	-6.36	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-8.75	0.50	-12.13	-10.61	-7.93	92.30	-16.45	92.30	-19.50
4Y	-18.85	0.65	-22.63	-20.18	-16.73	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-20.00	1.00	-24.04	-20.82	-17.03	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-30.05	0.65	-33.81	-30.90	-24.87	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-32.50	0.20	-36.12	-31.84	-24.62	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-38.75	-1.50	-40.15	-37.09	-29.67	1.75	-43.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-61.50	2.25
-59.50	3.50
-58.50	4.00
-59.75	3.50
-60.75	3.25
-62.00	3.00
-57.25	3.25
-45.00	3.50

CRS

USD/KRW 1157.50 (-1.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8400	-1.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-1.00	1.00
1.5Y	0.8350	-0.50	1.3950	1.1250	2*3Y	0.00	0.50
2Y	0.8300	0.00	1.3750	1.1550	2*5Y	-1.00	0.50
3Y	0.8300	0.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	0.8250	0.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-1.00	0.00
5Y	0.8200	0.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-0.50	0.00
7Y	0.8700	0.50	1.5750	0.0750	5*7Y	5.00	0.00
10Y	1.0250	0.50	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	1.6702	-0.0031	1.6733	1.6126	1.6285	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.9424	0.0246	1.9178	1.8320	1.8621	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	17.52	1.69	15.83	12.26	11.85	103.03	7.02	103.03	-108.00
10Y	14.24	5.66	8.58	2.20	2.51	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	6.00	1.00	5.00	4.50	3.50	29.00	-9.50	54.75	-9.50
KTB 2*10Y	30.50	-1.20	31.70	32.00	32.70	55.50	4.10	73.00	4.10
UST 2*10Y	27.22	2.77	24.45	21.94	23.36	37.15	-23.40	154.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	9y 52.75 / 54.25
06M			
09M	52		
01Y	45.5 / 47.25 / 47.5 / 49.5		
1.5Y			
02Y		SPRD	2*3y 1.25
03Y	43 / 46		3*4y 0.75
04Y	44		12*15y -0.5
05Y	50.5		
07Y			
10Y	55.5 / 56		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1*2y CCS -01		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	189 건	50	139	139	129	78	124	133
금 액	63,162 억원	17,025	46,137	44,908	35,310	22,414	49,280	54,711

장중동향

국고채 금리, 금리 급등세 접고 하락 마감.

IRS, 전 구간 금리 하락.
점심시간 이후 포린 중심으로 오퍼리시한 모습.

CRS, 2Y 이하 구간에서 금리 하락하며 혼조 마감.