

IPS Daily Morning Brief

2019-11-12

종가 기준일 2019-11-11

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4875	-1.00	1.4960	1.4278	1.4374	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4625	-1.00	1.4730	1.4104	1.3894	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4450	-1.00	1.4540	1.3920	1.3529	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4200	-1.00	1.4320	1.3694	1.3040	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.4025	-1.25	1.4145	1.3446	1.2616	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.4150	-1.25	1.4190	1.3428	1.2373	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.4200	-1.25	1.4225	1.3459	1.2286	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.4275	-1.25	1.4295	1.3501	1.2220	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.4300	-1.25	1.4330	1.3533	1.2179	2.2075	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.4600	-1.50	1.4640	1.3859	1.2455	2.2750	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4775	-1.50	1.4815	1.4016	1.2618	2.3150	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.4700	-1.75	1.4760	1.3960	1.2511	2.3425	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3675	-2.00	1.3820	1.3175	1.1739	2.3775	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-2.50	0.00	-2.30	-1.74	-4.80	7.75	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-1.75	0.00	-1.90	-1.84	-3.65	5.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-4.25	-0.25	-3.95	-4.74	-9.13	14.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	1.25	0.00	0.45	-0.19	-2.43	8.25	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	1.75	0.00	0.80	0.13	-3.30	13.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	2.50	0.00	1.50	0.55	-3.95	18.00	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	0.50	0.00	0.35	0.31	-0.87	6.00	-3.25	9.25	-3.25
3*5Y	1.25	0.00	1.05	0.74	-1.52	11.00	-5.25	18.25	-5.25
4*5Y	0.75	0.00	0.70	0.43	-0.65	5.00	-2.25	9.00	-2.25
5*7Y	0.25	0.00	0.35	0.31	-0.41	5.25	-1.75	12.50	-1.75
5*10Y	3.25	-0.25	3.45	3.58	2.35	12.25	0.50	26.75	0.50
7*10Y	3.00	-0.25	3.10	3.26	2.76	7.50	1.75	14.50	1.75
10*12Y	1.75	0.00	1.75	1.58	1.63	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	1.00	-0.25	1.20	1.01	0.56	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-9.25	-0.50	-8.20	-6.84	-7.16	10.25	-9.25	16.75	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.420	1.00	1.413	1.371	1.300	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.481	1.00	1.477	1.420	1.331	2.018	1.122	2.113	1.122
2Y	1.502	0.70	1.502	1.432	1.327	2.094	1.089	2.230	1.089
3Y	1.505	-1.00	1.529	1.450	1.317	2.147	0.092	2.315	0.092
4Y	1.611	-1.00	1.637	1.549	1.397	2.297	1.127	2.502	1.127
5Y	1.630	-1.00	1.657	1.561	1.393	2.402	1.122	2.602	1.122
7Y	1.736	-0.70	1.760	1.664	1.468	2.533	1.163	2.728	1.163
10Y	1.797	-0.30	1.815	1.708	1.494	2.612	1.170	2.815	1.170
20Y	1.767	-0.80	1.781	1.692	1.473	2.605	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	1.00
CALL	1.30	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.01	0.04	109.93	110.09	109.85
LKTb	129.10	0.12	128.87	129.34	128.43

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	2.50	-2.00	4.14	2.13	5.28	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-6.10	-2.00	-4.54	-5.08	-2.68	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-9.95	-1.95	-8.79	-8.69	-6.51	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-9.00	-0.25	-11.04	-10.68	-7.98	92.30	-16.45	92.30	-19.50
4Y	-19.10	-0.25	-21.45	-20.33	-16.82	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-20.25	-0.25	-22.79	-21.04	-17.13	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-30.60	-0.55	-32.66	-31.12	-25.06	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-33.70	-1.20	-35.12	-32.20	-24.88	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-39.95	-1.20	-39.94	-37.48	-29.91	1.75	-43.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS		USD/KRW				1166.80 (+9.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-60.50	1.00	1Y	0.8400	0.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-1.00	0.00
-58.50	1.00	1.5Y	0.8350	0.00	1.3950	1.1300	2*3Y	1.50	1.50
-57.25	1.25	2Y	0.8300	0.00	1.3750	1.1550	2*5Y	0.50	1.50
-57.00	2.75	3Y	0.8450	1.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00
-58.00	2.75	4Y	0.8400	1.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-1.00	0.00
-59.25	2.75	5Y	0.8350	1.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-0.50	0.00
-54.50	2.75	7Y	0.8850	1.50	1.5750	0.0750	5*7Y	5.00	0.00
-42.00	3.00	10Y	1.0400	1.50	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	0.0000	1.6702	1.6733	1.6126	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.9424	0.0000	1.9424	1.9178	1.8320	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	16.82	-0.7	17.52	15.83	12.26	103.03	7.02	103.03	-108.00
10Y	14.54	0.30	14.24	8.58	2.20	98.82	-5.81	98.82	-24.46

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	5.75	-0.25	6.00	5.00	4.50	29.00	-9.50	54.00	-9.50
KTb 2*10Y	29.50	-1.00	30.50	31.70	32.00	55.50	4.10	72.10	4.10
UST 2*10Y	27.22	0.00	27.22	24.45	21.94	36.11	-23.40	154.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	46.25 / 49								
01Y									
1.5Y									
02Y	43	SPRD	2*5y 2.5						
03Y									
04Y									
05Y	43 / 45.5								
07Y									
10Y	50.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	125 건	-64	189	139	139	129	78	124	
금 액	36,696 억원	-26,466	63,162	46,137	44,908	35,310	22,414	49,280	

장중동향
국고채 금리, 오후장 중반까지 금리 상승세를 보인다 저가 매수세에 급반락하며 롤러코스터 장세.

IRS, 장 후반 홍콩 우려 부각되며 금리 하락 전환해 마감.
장기구간에서는 외국계 오피가 이어져

CRS, 대부분 구간에서 금리 상승.