

IPS Daily Morning Brief

2019-11-14

종가 기준일 2019-11-13

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4775	-3.00	1.4990	1.4356	1.4408	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4450	-3.50	1.4730	1.4199	1.3944	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4225	-3.75	1.4540	1.4026	1.3593	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4025	-3.75	1.4325	1.3819	1.3122	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3850	-4.00	1.4165	1.3595	1.2710	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3900	-4.50	1.4250	1.3608	1.2487	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3975	-4.75	1.4310	1.3653	1.2410	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.4075	-5.25	1.4400	1.3709	1.2352	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.4125	-5.25	1.4440	1.3749	1.2314	2.2050	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.4425	-5.25	1.4755	1.4079	1.2593	2.2700	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4575	-5.50	1.4925	1.4238	1.2754	2.3100	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.4500	-5.50	1.4860	1.4184	1.2652	2.3375	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3425	-5.75	1.3830	1.3370	1.1870	2.3725	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-3.25	-0.50	-2.60	-1.58	-4.63	7.25	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.25	-0.25	-1.90	-1.73	-3.51	5.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-3.75	-0.25	-3.75	-4.31	-8.83	14.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.50	-0.50	0.85	0.12	-2.23	8.25	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	1.25	-0.75	1.45	0.57	-3.00	13.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	2.25	-1.25	2.35	1.14	-3.58	18.00	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	0.75	-0.25	0.60	0.45	-0.77	6.00	-3.25	9.25	-3.25
3*5Y	1.75	-0.75	1.50	1.01	-1.35	11.00	-5.25	18.00	-5.25
4*5Y	1.00	-0.50	0.90	0.56	-0.58	5.00	-2.25	9.00	-2.25
5*7Y	0.50	0.00	0.40	0.40	-0.38	5.25	-1.75	12.50	-1.75
5*10Y	3.50	0.00	3.55	3.70	2.40	12.25	0.50	26.75	0.50
7*10Y	3.00	0.00	3.15	3.30	2.79	7.50	1.75	14.50	1.75
10*12Y	1.50	-0.25	1.70	1.59	1.61	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	0.75	-0.25	1.05	1.05	0.59	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-10.00	-0.50	-9.25	-7.09	-7.23	10.25	-10.00	16.75	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.438	-0.30	1.424	1.386	1.310	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.495	-1.50	1.487	1.439	1.343	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.497	-3.50	1.508	1.452	1.340	2.090	1.089	2.230	1.089
3Y	1.502	-5.10	1.525	1.472	1.330	2.140	0.092	2.315	0.092
4Y	1.602	-5.50	1.629	1.574	1.412	2.285	1.127	2.502	1.127
5Y	1.611	-6.10	1.646	1.586	1.409	2.395	1.122	2.602	1.122
7Y	1.717	-6.00	1.750	1.691	1.486	2.527	1.163	2.728	1.163
10Y	1.785	-5.70	1.811	1.737	1.513	2.607	1.170	2.815	1.170
20Y	1.752	-4.80	1.777	1.719	1.491	2.600	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	0.00
CALL	1.32	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.05	0.19	109.92	110.05	109.88
LKTb	129.23	0.68	128.80	129.23	128.67

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	-1.55	-3.45	3.00	1.67	4.94	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-9.25	-2.25	-5.49	-5.70	-3.05	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-11.20	-0.50	-9.17	-9.29	-6.86	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-11.20	0.60	-10.00	-11.13	-8.14	92.30	-16.45	92.30	-19.50
4Y	-20.45	0.75	-19.82	-20.83	-17.07	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-20.35	0.85	-20.56	-21.54	-17.34	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-30.45	0.75	-30.60	-31.58	-25.44	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-34.25	0.45	-33.57	-32.95	-25.42	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-40.95	-0.95	-39.38	-38.23	-30.43	1.75	-43.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1167.80 (+7.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-62.75	1.25	1Y	0.7950	-2.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-3.00	-1.00		
-62.75	0.25	1.5Y	0.7750	-3.50	1.3950	1.1300	2*3Y	3.50	1.50		
-62.00	0.50	2Y	0.7650	-3.50	1.3750	1.1550	2*5Y	2.50	1.50		
-59.00	2.50	3Y	0.8000	-2.00	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00		
-60.25	2.75	4Y	0.7950	-2.00	1.4600	0.0350	3*5Y	-1.00	0.00		
-61.75	3.25	5Y	0.7900	-2.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-0.50	0.00		
-57.25	3.25	7Y	0.8400	-2.00	1.5750	0.0750	5*7Y	5.00	0.00		
-44.75	3.25	10Y	0.9950	-2.00	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	1.6382	-0.0241	1.6623	1.6702	1.6702	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.8817	-0.0468	1.9285	1.9424	1.9424	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	14.12	1.09	13.03	16.82	17.52	103.03	7.02	103.03	-108.00
10Y	9.67	1.02	8.65	14.54	14.24	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	-1.25	7.00	5.75	6.00	29.00	-9.50	53.50	-9.50
KTb 2*10Y	28.80	-2.20	31.00	29.50	30.50	55.50	4.10	71.70	4.10
UST 2*10Y	24.35	-2.27	26.62	27.22	27.22	35.55	-23.40	152.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	49.75								
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	38.25 / 39.75 / 40 / 42.5				SPRD	6m*3y -08			
03Y	41.5 / 41.75 / 43.75					2*4y 1.25			
04Y									
05Y	41 / 42 / 42.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1.5y CCS 80.5								
	1*2y CCS -02								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황			149 건	26	123	125	189	139	129
금 액			57,500 억원	14,965	42,535	36,696	63,162	46,137	35,310

장중동향
국고채 금리, 변동성 심한 롤러코스터 장세에 금리 상승.

IRS, 전 구간 금리 상승.
장 초반 오픈 우위 장세에서 글로벌 금리가 오르자 되감는 모습.

CRS, 대부분 구간에서 금리 하락.