

IPS Daily Morning Brief

2019-11-15

종가 기준일 2019-11-14

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4725	-0.50	1.4885	1.4408	1.4423	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4400	-0.50	1.4600	1.4239	1.3967	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4175	-0.50	1.4400	1.4063	1.3622	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3975	-0.50	1.4180	1.3855	1.3161	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3800	-0.50	1.4015	1.3636	1.2755	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3850	-0.50	1.4105	1.3655	1.2542	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3900	-0.75	1.4170	1.3703	1.2469	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3975	-1.00	1.4265	1.3764	1.2414	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.4025	-1.00	1.4305	1.3808	1.2378	2.2050	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.4300	-1.25	1.4605	1.4136	1.2658	2.2700	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4425	-1.50	1.4765	1.4294	1.2818	2.3100	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.4350	-1.50	1.4695	1.4241	1.2718	2.3375	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3275	-1.50	1.3650	1.3413	1.1931	2.3725	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-3.25	0.00	-2.85	-1.69	-4.56	7.25	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.25	0.00	-2.00	-1.76	-3.45	5.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-3.75	0.00	-3.85	-4.26	-8.67	14.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.50	0.00	0.90	0.19	-2.14	8.25	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	1.00	-0.25	1.55	0.66	-2.86	13.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	1.75	-0.50	2.50	1.28	-3.41	18.00	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	0.50	-0.25	0.65	0.48	-0.73	6.00	-3.25	9.25	-3.25
3*5Y	1.25	-0.50	1.60	1.09	-1.28	11.00	-5.25	18.00	-5.25
4*5Y	0.75	-0.25	0.95	0.61	-0.55	5.00	-2.25	9.00	-2.25
5*7Y	0.50	0.00	0.40	0.44	-0.36	5.25	-1.75	12.50	-1.75
5*10Y	3.25	-0.25	3.40	3.73	2.43	12.25	0.50	26.75	0.50
7*10Y	2.75	-0.25	3.00	3.29	2.80	7.50	1.75	14.50	1.75
10*12Y	1.25	-0.25	1.60	1.58	1.60	4.00	1.25	6.75	-0.25
10*15Y	0.50	-0.25	0.90	1.05	0.60	6.75	-0.25	11.25	-0.75
10*20Y	-10.25	-0.25	-9.55	-7.24	-7.27	10.25	-10.25	16.75	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.367	-7.10	1.415	1.389	1.314	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.441	-5.40	1.480	1.444	1.348	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.498	0.10	1.505	1.459	1.346	2.090	1.089	2.230	1.089
3Y	1.500	-0.20	1.515	1.478	1.336	2.140	0.092	2.315	0.092
4Y	1.601	-0.10	1.618	1.581	1.419	2.285	1.127	2.502	1.127
5Y	1.610	-0.10	1.633	1.594	1.416	2.395	1.122	2.602	1.122
7Y	1.715	-0.20	1.738	1.699	1.494	2.527	1.163	2.728	1.163
10Y	1.782	-0.30	1.801	1.748	1.523	2.607	1.170	2.815	1.170
20Y	1.746	-0.60	1.768	1.729	1.500	2.600	1.146	2.792	1.146

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	0.00
CALL	1.30	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.05	0.00	110.08	110.10	109.97
LKTb	129.26	0.03	129.41	129.42	129.04

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	5.05	6.60	2.48	1.72	4.85	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-4.35	4.90	-6.16	-5.84	-3.17	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-11.80	-0.60	-10.33	-9.55	-7.03	-0.25	-12.75	-0.25	-25.15
3Y	-11.50	-0.30	-10.45	-11.26	-8.22	92.30	-16.45	92.30	-19.50
4Y	-21.10	-0.65	-20.14	-21.06	-17.18	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-21.25	-0.90	-20.61	-21.77	-17.44	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-31.25	-0.80	-30.71	-31.83	-25.62	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-35.20	-0.95	-34.07	-33.39	-25.69	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-41.85	-0.90	-40.30	-38.76	-30.66	1.75	-43.00	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1169.70 (+1.90)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-67.25	-4.50	1Y	0.7450	-5.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-3.00	0.00
-67.25	-4.50	1.5Y	0.7250	-5.00	1.3950	1.1300	2*3Y	4.00	0.50
-66.50	-4.50	2Y	0.7150	-5.00	1.3750	1.1550	2*5Y	3.00	0.50
-63.00	-4.00	3Y	0.7550	-4.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00
-64.00	-3.75	4Y	0.7500	-4.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-1.00	0.00
-65.25	-3.50	5Y	0.7450	-4.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-0.50	0.00
-60.75	-3.50	7Y	0.7950	-4.50	1.5750	0.0750	5*7Y	5.00	0.00
-48.00	-3.25	10Y	0.9500	-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	1.6097	-0.0285	1.6382	1.6623	1.6702	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.8229	-0.0588	1.8817	1.9285	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	11.17	-2.95	14.12	13.03	16.82	103.03	7.02	103.03	-108.00
10Y	4.09	-5.58	9.67	8.65	14.54	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	5.00	-0.75	5.75	7.00	5.75	29.00	-9.50	52.75	-9.50
KTb 2*10Y	28.40	-0.40	28.80	31.00	29.50	55.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	21.32	-3.03	24.35	26.62	27.22	35.55	-23.40	151.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS			ODD Tenor							
06M	47									
09M	43.5									
01Y										
1.5Y	39.5 / 39.75									
02Y	37.5 / 37.75 / 38		SPRD	1*2y	-4.5					
03Y	37.75			1.5*4y	-01					
04Y	38.75			5*10y	3.25					
05Y				7*10y	03					
07Y	41.25									
10Y	44.25									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	3y CCS 75.5									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			104 건	-45	149	123	125	189	139	139
금 액			41,210 억원	-16,290	57,500	42,535	36,696	63,162	46,137	44,908

장중동향
국고채 금리, 3년 이하 단가물 금리 상승, 나머지 구간 금리 하락하며 혼조세. 커브 플랫트닝.

IRS, 전 구간 금리 하락.
CD 발행이 주춤하면서 단기구간도 금리 다소 하락.

CRS, 금리 하락 마감.