

IPS Daily Morning Brief

2019-11-22

종가 기준일 2019-11-21

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4800	0.75	1.4770	1.4676	1.4488	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4550	1.25	1.4465	1.4464	1.4065	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4325	1.50	1.4235	1.4280	1.3745	1.9200	1.2200	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4000	1.75	1.3930	1.4049	1.3329	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3675	2.25	1.3640	1.3824	1.2950	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3525	2.00	1.3570	1.3821	1.2772	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3400	2.25	1.3530	1.3838	1.2712	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3300	2.50	1.3490	1.3871	1.2666	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3175	2.00	1.3445	1.3881	1.2633	2.2050	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3400	2.25	1.3665	1.4173	1.2914	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3300	2.25	1.3650	1.4285	1.3056	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3075	2.25	1.3510	1.4215	1.2961	2.3250	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1900	3.25	1.2350	1.3281	1.2141	2.3400	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-2.50	0.50	-3.05	-2.13	-4.23	7.25	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.25	0.25	-2.30	-1.84	-3.20	5.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-6.50	0.75	-5.95	-4.56	-7.95	14.00	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-1.50	-0.25	-0.70	-0.02	-1.78	8.25	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-2.75	0.00	-1.10	0.14	-2.38	13.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-3.75	0.25	-1.50	0.47	-2.84	18.00	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	-1.25	0.25	-0.40	0.16	-0.60	6.00	-3.25	9.25	-3.25
3*5Y	-2.25	0.50	-0.80	0.50	-1.06	11.00	-5.25	18.00	-5.25
4*5Y	-1.00	0.25	-0.40	0.34	-0.46	5.00	-2.25	9.00	-2.25
5*7Y	-1.25	-0.50	-0.45	0.10	-0.32	5.25	-1.75	12.50	-1.75
5*10Y	1.00	-0.25	1.75	3.01	2.48	12.25	0.50	26.75	0.50
7*10Y	2.25	0.25	2.20	2.91	2.80	7.50	1.75	14.25	1.75
10*12Y	-1.00	0.00	-0.15	1.13	1.42	4.00	-1.00	6.75	-1.00
10*15Y	-3.25	0.00	-1.55	0.43	0.47	6.75	-3.25	11.00	-3.25
10*20Y	-15.00	1.00	-13.15	-8.91	-7.73	9.75	-16.00	16.50	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.436	0.20	1.439	1.418	1.337	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.471	0.90	1.481	1.471	1.374	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.467	0.30	1.484	1.486	1.371	2.065	1.089	2.230	1.089
3Y	1.467	2.50	1.484	1.502	1.364	2.137	0.092	2.315	0.092
4Y	1.540	2.30	1.562	1.601	1.449	2.264	1.127	2.502	1.127
5Y	1.540	2.30	1.563	1.612	1.446	2.380	1.122	2.602	1.122
7Y	1.622	1.80	1.662	1.715	1.530	2.503	1.163	2.728	1.163
10Y	1.680	1.40	1.729	1.770	1.564	2.585	1.170	2.815	1.170
20Y	1.621	-2.10	1.492	1.691	1.520	2.580	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	0.00
CALL	1.29	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.23	-0.07	110.29	110.37	110.18
LKTb	130.40	-0.13	130.51	130.93	130.25

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-0.35	1.30	-1.59	1.02	3.73	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-7.10	0.85	-8.82	-6.63	-4.07	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-9.95	1.95	-12.02	-10.41	-7.62	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-11.45	-0.50	-12.72	-12.03	-8.65	92.30	-16.45	92.30	-19.50
4Y	-20.00	-0.05	-20.88	-21.69	-17.77	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-21.00	0.20	-21.38	-22.52	-17.98	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-30.45	0.20	-31.75	-32.72	-26.69	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-34.00	0.85	-36.27	-35.32	-27.23	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-43.10	5.35	-25.70	-36.31	-30.60	52.25	-48.45	52.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1178.10 (+8.00)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-73.25	-4.00	1Y	0.7000	-2.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-15.00	-3.00
-80.00	-7.25	1.5Y	0.6000	-5.50	1.3950	1.1850	2*3Y	1.00	-0.50
-81.75	-7.75	2Y	0.5500	-5.50	1.3750	1.1850	2*5Y	-0.50	0.50
-79.25	-8.00	3Y	0.5600	-6.00	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	0.50
-78.50	-7.75	4Y	0.5550	-5.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-1.50	1.00
-78.50	-7.50	5Y	0.5450	-5.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-1.00	0.50
-71.75	-7.00	7Y	0.6000	-5.00	1.5750	0.0750	5*7Y	5.50	0.00
-59.00	-7.25	10Y	0.7500	-5.00	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	1.6107	0.0330	1.5777	1.5899	1.6062	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.7757	0.0266	1.7491	1.7860	1.8196	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	14.37	3	11.37	10.89	10.42	103.03	7.02	103.03	-108.00
10Y	9.57	1.26	8.31	6.10	3.96	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	-2.75	0.00	-2.75	-0.25	2.75	29.00	-9.50	52.75	-9.50
KTb 2*10Y	21.30	1.10	20.20	24.40	27.80	55.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	16.50	-0.64	17.14	19.61	21.34	34.56	-23.40	151.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M	47.5								
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y			SPRD	1.5*2y	-3.5				
03Y	33.5			2*10y	-3.25				
04Y				4*7y	-2.5				
05Y	29.75 / 30.5 / 31			5*10y	1.25				
07Y									
10Y	34								
12Y	29.5								
15Y	29								
20Y	17 / 19								
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	121 건	-47	168	148	58	83	104	149	
금 액	35,735 억원	-14,283	50,018	47,975	17,418	18,469	41,210	57,500	

장중동향
국고채 금리, 무역 협상 소식에 민감하게 반응하며 혼조 마감.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.

CRS, 금리 하락 마감.