

IPS Daily Morning Brief

2019-12-09

종가 기준일 2019-12-06

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4750	1.25	1.4645	1.4740	1.4550	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4400	1.25	1.4325	1.4453	1.4178	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4125	1.25	1.4050	1.4215	1.3884	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3900	1.50	1.3790	1.3945	1.3522	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3675	1.75	1.3540	1.3690	1.3193	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3650	2.00	1.3510	1.3655	1.3073	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3650	2.25	1.3510	1.3648	1.3039	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3625	2.25	1.3495	1.3640	1.3014	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3600	2.50	1.3485	1.3620	1.2989	2.2050	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3850	2.50	1.3745	1.3868	1.3267	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3925	2.75	1.3765	1.3884	1.3372	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3725	2.75	1.3565	1.3724	1.3268	2.3250	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2550	3.25	1.2350	1.2556	1.2363	2.3400	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-3.50	0.00	-3.20	-2.88	-3.72	6.75	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.75	0.00	-2.75	-2.38	-2.94	5.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-4.50	0.50	-5.10	-5.25	-6.91	14.00	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-0.25	0.25	-0.30	-0.35	-1.21	7.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-0.25	0.50	-0.30	-0.42	-1.55	13.00	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-0.50	0.50	-0.45	-0.50	-1.80	18.00	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	0.00	0.25	0.00	-0.08	-0.34	6.00	-3.25	9.25	-3.25
3*5Y	-0.25	0.25	-0.15	-0.15	-0.59	11.00	-5.25	18.00	-5.25
4*5Y	-0.25	0.00	-0.15	-0.07	-0.25	5.00	-2.25	9.00	-2.25
5*7Y	-0.25	0.25	-0.10	-0.20	-0.25	5.25	-1.75	12.50	-1.75
5*10Y	2.25	0.25	2.50	2.28	2.53	12.25	0.50	26.75	0.50
7*10Y	2.50	0.00	2.60	2.48	2.78	7.50	1.75	14.25	1.75
10*12Y	0.75	0.25	0.20	0.16	1.05	4.00	-1.00	6.75	-1.00
10*15Y	-1.25	0.25	-1.80	-1.44	0.01	6.50	-3.25	10.25	-3.25
10*20Y	-13.00	0.75	-13.95	-13.11	-9.04	8.00	-16.00	13.50	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.378	0.50	1.379	1.412	1.363	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.408	0.60	1.405	1.450	1.400	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.412	0.50	1.415	1.459	1.400	2.062	1.089	2.230	1.089
3Y	1.430	1.00	1.427	1.464	1.399	2.127	0.092	2.315	0.092
4Y	1.505	1.50	1.503	1.547	1.487	2.244	1.127	2.502	1.127
5Y	1.515	2.50	1.511	1.555	1.487	2.370	1.122	2.602	1.122
7Y	1.603	2.70	1.603	1.649	1.579	2.492	1.163	2.728	1.163
10Y	1.685	3.00	1.686	1.718	1.623	2.585	1.170	2.815	1.170
20Y	1.630	1.00	1.647	1.628	1.580	2.565	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	0.00
CALL	1.24	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.32	-0.04	110.31	110.37	110.29
LKTb	130.35	-0.30	130.40	130.69	130.27

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	3.45	0.75	2.62	0.97	2.49	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-1.80	0.90	-2.64	-5.56	-4.74	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-4.45	1.25	-6.08	-9.02	-8.10	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-6.50	1.00	-7.64	-9.82	-9.20	92.30	-16.45	92.30	-19.50
4Y	-14.00	0.75	-15.22	-18.27	-18.30	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-15.25	-0.25	-16.19	-19.11	-18.59	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-24.30	-0.20	-25.47	-28.66	-28.00	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-30.00	-0.50	-31.13	-33.17	-29.62	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-37.50	2.25	-41.20	-37.26	-34.34	52.25	-48.45	52.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1189.60 (-0.60)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-61.25	2.25	1Y	0.8000	3.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-16.50	-0.50	
-68.00	2.00	1.5Y	0.7100	3.50	1.3950	1.1850	2*3Y	-2.00	-1.50	
-73.25	1.25	2Y	0.6350	3.00	1.3750	1.1850	2*5Y	-6.50	-2.50	
-75.00	-0.50	3Y	0.6150	1.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-2.50	-1.00	
-77.50	-1.75	4Y	0.5900	0.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-4.50	-1.00	
-79.25	-1.75	5Y	0.5700	0.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-2.00	0.00	
-69.50	-0.50	7Y	0.6650	2.00	1.5750	0.0750	5*7Y	9.50	1.50	
-62.00	-2.00	10Y	0.7650	0.50	1.7800	0.2550	5*10Y	19.50	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	1.6331	0.0448	1.5883	1.5722	1.5440	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.8407	0.0287	1.8120	1.7766	1.7182	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	22.11	3.98	18.13	17.72	10.90	103.03	7.02	103.03	-104.00
10Y	15.57	-0.13	15.70	12.46	-1.88	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	1.75	0.75	1.00	1.00	3.25	29.00	-9.50	52.75	-9.50
KTb 2*10Y	27.30	2.50	24.80	25.70	30.20	55.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	20.76	-1.61	22.37	20.44	17.42	34.56	-23.40	151.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS				ODD Tenor						
06M										
09M										
01Y	40.5									
1.5Y	37.75									
02Y				SPRD	10*12y 0.75					
03Y					10*20y -13					
04Y					5*6y 00					
05Y										
07Y	34.75									
10Y										
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6		
거래현황	79 건	25	54	134	127	93	73	88		
금 액	33,050 억원	12,167	20,883	33,318	39,109	22,788	22,005	31,315		

장중동향
국고채 금리, 미중 무역합의 청신호에 금리 상승 마감.
중국에 대두와 소고기 등 일부 미국산 상품에 대한 관세 면세 조치에 나서는 등 미중 무역 협상과 관련해 긍정적 소식.

IRS, 전 구간 금리 상승.
조용한 가운데 장기구간은 장중 변동성 확대되며 비디시.

CRS, 금리 상승.