IPS Daily Morning Brief

2019-11-21

종가 기준일 2019-11-20

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4725	-0.25	1.4755	1.4635	1.4474	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4425	0.00	1.4435	1.4428	1.4044	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4175	-0.25	1.4205	1.4245	1.3720	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3825	-0.50	1.3925	1.4016	1.3295	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3450	-1.00	1.3665	1.3791	1.2911	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3325	-1.25	1.3635	1.3791	1.2727	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3175	-2.50	1.3630	1.3815	1.2666	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3050	-3.25	1.3625	1.3856	1.2619	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2975	-3.50	1.3615	1.3874	1.2588	2.2050	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3175	-3.50	1.3845	1.4173	1.2868	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3075	-4.25	1.3875	1.4296	1.3015	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.2850	-5.50	1.3765	1.4234	1.2920	2.3250	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1575	-7.00	1.2625	1.3324	1.2108	2.3400	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-3.00	0.25	-3.20	-2.08	-4.30	7.25	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.50	-0.25	-2.30	-1.83	-3.24	5.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-7.25	-0.75	-5.40	-4.54	-8.09	14.00	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-1.25	-0.25	-0.30	0.00	-1.84	8.25	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-2.75	-1.50	-0.35	0.24	-2.45	13.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-4.00	-2.25	-0.40	0.65	-2.92	18.00	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	-1.50	-1.25	-0.05	0.24	-0.61	6.00	-3.25	9.25	-3.25
3*5Y	-2.75	-2.00	-0.10	0.65	-1.08	11.00	-5.25	18.00	-5.25
4*5Y	-1.25	-0.75	-0.05	0.41	-0.47	5.00	-2.25	9.00	-2.25
5*7Y	-0.75	-0.25	-0.10	0.18	-0.31	5.25	-1.75	12.50	-1.75
5*10Y	1.25	-0.25	2.20	3.16	2.49	12.25	0.50	26.75	0.50
7*10Y	2.00	0.00	2.30	2.99	2.80	7.50	1.75	14.25	1.75
10*12Y	-1.00	-0.75	0.30	1.24	1.47	4.00	-1.00	6.75	-1.00
10*15Y	-3.25	-2.00	-0.80	0.61	0.52	6.75	-3.25	11.00	-3.25
10*20Y	-16.00	-3.50	-12.20	-8.49	-7.60	9.75	-16.00	16.50	-16.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.434	-0.50	1.426	1.413	1.333	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.462	-1.50	1.475	1.467	1.369	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.464	-1.70	1.490	1.483	1.367	2.065	1.089	2.230	1.089
3Y	1.442	-3.80	1.491	1.499	1.359	2.137	0.092	2.315	0.092
4Y	1.517	-3.50	1.574	1.598	1.443	2.264	1.127	2.502	1.127
5Y	1.517	-3.50	1.577	1.610	1.441	2.380	1.122	2.602	1.122
7Y	1.604	-5.30	1.681	1.714	1.524	2.503	1.163	2.728	1.163
10Y	1.666	-5.90	1.750	1.768	1.556	2.585	1.170	2.815	1.170
20Y	1.642	93.70	1.517	1.693	1.514	2.580	0.705	2.792	0.705

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.30	0.13	110.23	110.30	110.20
LKTB	130.53	0.66	130.10	130.53	130.04

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	-1.65	0.25	-0.51	1.12	3.91	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-7.95	1.00	-8.27	-6.56	-3.96	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-11.90	0.70	-12.39	-10.37	-7.57	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-10.95	2.55	-12.73	-11.98	-8.58	92.30	-16.45	92.30	-19.50
4Y	-19.95	1.00	-21.10	-21.68	-17.67	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-21.20	0.25	-21.43	-22.46	-17.90	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-30.65	1.80	-31.91	-32.69	-26.50	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-34.85	2.40	-36.51	-35.11	-26.97	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-48.45	-100.70	-25.45	-36.04	-30.31	52.25	-48.45	52.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-69.25	-3.25
-72.75	-4.00
-74.00	-3.50
-71.25	-3.25
-70.75	-2.00
-71.00	-1.25
-64.75	-1.00
-51.75	-1.00

CRS

USD/KRW 1170.10 (+2.50)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.7250	-3.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-12.00	-1.00
1.5Y	0.6550	-4.50	1.3950	1.1600	2*3Y	1.50	0.00
2Y	0.6050	-4.50	1.3750	1.1800	2*5Y	-1.00	0.00
3Y	0.6200	-4.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-1.00	0.00
4Y	0.6100	-4.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-2.50	0.00
5Y	0.5950	-4.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-1.50	0.00
7Y	0.6500	-4.50	1.5750	0.0750	5*7Y	5.50	0.00
10Y	0.8000	-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	1.5777	-0.0122	1.5899	1.6062	1.6101	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.7491	-0.0369	1.7860	1.8196	1.8325	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	11.37	0.48	10.89	10.42	10.31	103.03	7.02	103.03	-108.00
10Y	8.31	2.21	6.10	3.96	3.75	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	-2.50	-0.25	2.75	4.25	29.00	-9.50	52.75	-9.50
KTB 2*10Y	20.20	-4.20	24.40	27.80	28.80	55.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	17.14	-2.47	19.61	21.34	22.24	34.56	-23.40	151.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	43.5		
01Y	41		
1.5Y			
02Y	34.5	SPRD	9*12m -2.25
03Y	31.75		1*5y -10.75
04Y	01월 30일		2*10y -1.75
05Y	32.5		3*4y -0.75 / -01
07Y			5*10y 1.75 / 1.5
10Y			10*15y -1.75
12Y			10*20y -14
15Y			2*3*4y -0.5
20Y			
CRS	5y CCS 59		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	168 건	20	148	58	83	104	149	123
금 액	50,018 억원	2,043	47,975	17,418	18,469	41,210	57,500	42,535

장중동향

국고채 금리, 장기물 초강세 분위기에 금리 하락 마감.

IRS, 대부분 구간에서 금리 하락.
중장기 구간을 중심으로 오퍼가 강한 모습.

CRS, 전 구간 금리 하락.