IPS Daily Morning Brief

2019-11-26

종가 기준일 2019-11-25

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4850	0.25	1.4790	1.4736	1.4515	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4650	0.50	1.4530	1.4508	1.4107	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4450	0.50	1.4310	1.4310	1.3795	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4200	1.00	1.4000	1.4070	1.3390	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3900	1.50	1.3665	1.3835	1.3018	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3800	2.25	1.3535	1.3821	1.2849	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3775	3.00	1.3450	1.3831	1.2792	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3750	3.50	1.3375	1.3858	1.2748	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3700	3.50	1.3305	1.3861	1.2716	2.2050	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3975	3.75	1.3535	1.4143	1.2997	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3900	3.75	1.3460	1.4234	1.3130	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3675	3.75	1.3260	1.4145	1.3034	2.3250	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2475	3.75	1.2065	1.3161	1.2199	2.3400	0.9125	2.5600	0.9125
6*9M	-2.00	0.25	-2.60	-2.29	-4.08	7.25	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.00	0.00	-2.20	-1.98	-3.13	5.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-5.50	1.00	-6.45	-4.75	-7.77	14.00	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-1.00	0.75	-1.30	-0.14	-1.69	7.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-1.25	1.50	-2.15	-0.04	-2.26	13.00	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-1.50	2.00	-2.90	0.22	-2.70	18.00	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	-0.25	0.75	-0.85	0.10	-0.57	6.00	-3.25	9.25	-3.25
3*5Y	-0.50	1.25	-1.60	0.36	-1.00	11.00	-5.25	18.00	-5.25
4*5Y	-0.25	0.50	-0.75	0.26	-0.43	5.00	-2.25	9.00	-2.25
5*7Y	-0.50	0.00	-0.70	0.04	-0.32	5.25	-1.75	12.50	-1.75
5*10Y	2.25	0.25	1.60	2.85	2.49	12.25	0.50	26.75	0.50
7*10Y	2.75	0.25	2.30	2.81	2.81	7.50	1.75	14.25	1.75
10*12Y	-0.75	0.00	-0.75	0.91	1.33	4.00	-1.00	6.75	-1.00
10*15Y	-3.00	0.00	-2.75	0.02	0.37	6.75	-3.25	11.00	-3.25
10*20Y	-15.00	0.00	-14.70	-9.81	-7.98	9.75	-16.00	16.50	-16.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.423	-0.50	1.432	1.420	1.345	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.456	0.00	1.464	1.472	1.381	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.467	1.20	1.467	1.486	1.379	2.062	1.089	2.230	1.089
3Y	1.472	1.70	1.463	1.500	1.372	2.127	0.092	2.315	0.092
4Y	1.561	2.10	1.542	1.597	1.458	2.244	1.127	2.502	1.127
5Y	1.575	2.50	1.547	1.610	1.456	2.370	1.122	2.602	1.122
7Y	1.659	2.50	1.635	1.711	1.542	2.492	1.163	2.728	1.163
10Y	1.725	2.70	1.699	1.769	1.577	2.585	1.170	2.815	1.170
20Y	1.680	2.80	1.460	1.685	1.532	2.565	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	0.00
CALL	1.27	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.20	-0.07	110..25	110.27	110.16
LKTB	129.92	-0.32	130.14	130.26	129.84

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	2.20	1.00	-0.10	1.10	3.48	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-3.60	1.00	-6.44	-6.48	-4.21	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-7.70	0.30	-10.03	-10.22	-7.69	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-9.20	0.55	-10.97	-11.79	-8.71	92.30	-16.45	92.30	-19.50
4Y	-18.35	0.90	-19.70	-21.42	-17.91	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-20.00	1.00	-20.93	-22.39	-18.12	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-28.90	1.00	-30.47	-32.44	-26.99	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-32.75	1.05	-34.53	-35.43	-27.71	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-43.25	0.95	-25.35	-36.87	-31.20	52.25	-48.45	52.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-66.00	3.00
-74.50	2.50
-80.00	-0.50
-79.00	-1.75
-79.25	-2.50
-81.00	-3.50
-73.50	-3.00
-63.75	-5.25

CRS

USD/KRW 1176.00 (-2.90)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.7850	3.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-19.50	-2.50
1.5Y	0.6750	3.50	1.3950	1.1850	2*3Y	0.00	-0.50
2Y	0.5900	1.00	1.3750	1.1850	2*5Y	-2.50	-1.00
3Y	0.5900	0.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	0.5850	0.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-2.50	-0.50
5Y	0.5650	0.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-2.00	-0.50
7Y	0.6350	0.50	1.5750	0.0750	5*7Y	7.00	0.50
10Y	0.7600	-1.50	1.7800	0.2550	5*10Y	19.50	-1.50

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	1.6031	-0.0122	1.6153	1.6107	1.5777	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.7568	-0.0163	1.7731	1.7757	1.7491	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	13.61	-2.42	16.03	14.37	11.37	103.03	7.02	103.03	-108.00
10Y	3.18	-4.33	7.51	9.57	8.31	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	0.75	2.25	-1.50	-2.75	-2.75	29.00	-9.50	52.75	-9.50
KTB 2*10Y	25.80	1.50	24.30	21.30	20.20	55.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	15.37	-0.41	15.78	16.50	17.14	34.56	-23.40	151.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	44.75		
1.5Y			
02Y		SPRD	2*3y -2
03Y	37		2*5y -1.5
04Y			9*10y 1
05Y	37.5		
07Y			
10Y	36.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y CCS 77.5 2y CCS 57.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	51 건	-35	86	121	168	148	58	83
금 액	14,995 억원	-7,310	22,305	35,735	50,018	47,975	17,418	18,469

장중동향

국고채 금리, 무역협상 낙관론 반영하며 금리 상승 마감.

IRS, 국채선물에 연동되며 전 구간 금리 상승.
최근 10년 구간을 중심으로 금리가 많이 눌렸던 현상은 잠잠해져.

CRS, 7Y 이상 구간에서 금리 하락하며 혼조 마감.