

IPS Daily Morning Brief

2019-11-25

종가 기준일 2019-11-22

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4825	0.25	1.4775	1.4714	1.4502	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4600	0.50	1.4490	1.4496	1.4087	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4400	0.75	1.4265	1.4309	1.3772	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4100	1.00	1.3950	1.4073	1.3361	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3750	0.75	1.3630	1.3843	1.2986	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3575	0.50	1.3515	1.3835	1.2812	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3475	0.75	1.3445	1.3846	1.2753	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3400	1.00	1.3380	1.3875	1.2708	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3350	1.75	1.3320	1.3881	1.2675	2.2050	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3600	2.00	1.3540	1.4166	1.2956	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3525	2.25	1.3495	1.4268	1.3094	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3300	2.25	1.3325	1.4189	1.2998	2.3250	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2100	2.00	1.2145	1.3230	1.2171	2.3400	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-2.25	0.25	-2.85	-2.18	-4.15	7.25	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.00	0.25	-2.25	-1.88	-3.15	5.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-6.50	0.00	-6.35	-4.66	-7.86	14.00	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-1.75	-0.25	-1.15	-0.08	-1.74	7.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-2.75	0.00	-1.85	0.04	-2.33	13.00	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-3.50	0.25	-2.50	0.32	-2.78	18.00	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	-1.00	0.25	-0.70	0.11	-0.59	6.00	-3.25	9.25	-3.25
3*5Y	-1.75	0.50	-1.35	0.40	-1.04	11.00	-5.25	18.00	-5.25
4*5Y	-0.75	0.25	-0.65	0.29	-0.45	5.00	-2.25	9.00	-2.25
5*7Y	-0.50	0.75	-0.60	0.06	-0.32	5.25	-1.75	12.50	-1.75
5*10Y	2.00	1.00	1.60	2.91	2.48	12.25	0.50	26.75	0.50
7*10Y	2.50	0.25	2.20	2.85	2.81	7.50	1.75	14.25	1.75
10*12Y	-0.75	0.25	-0.45	1.01	1.38	4.00	-1.00	6.75	-1.00
10*15Y	-3.00	0.25	-2.15	0.23	0.42	6.75	-3.25	11.00	-3.25
10*20Y	-15.00	0.00	-13.95	-9.36	-7.85	9.75	-16.00	16.50	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.000	-143.60	1.438	1.420	1.340	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	0.000	-147.10	1.476	1.474	1.376	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	0.000	-146.70	1.479	1.489	1.374	2.062	1.089	2.230	1.089
3Y	0.000	-146.70	1.477	1.505	1.366	2.127	0.092	2.315	0.092
4Y	0.000	-154.00	1.551	1.604	1.452	2.244	1.127	2.502	1.127
5Y	0.000	-154.00	1.551	1.616	1.450	2.370	1.122	2.602	1.122
7Y	0.000	-162.20	1.647	1.719	1.534	2.492	1.163	2.728	1.163
10Y	0.000	-168.00	1.713	1.775	1.568	2.585	1.170	2.815	1.170
20Y	0.000	-162.10	1.427	1.691	1.524	2.565	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	0.00
CALL	1.28	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.27	0.04	110.23	110.29	110.12
LKTB	130.24	-0.16	130.44	130.54	130.04

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	144.00	144.35	27.59	8.20	5.97	144.00	-9.65	144.00	-17.75
1.5Y	141.00	148.10	21.42	0.70	-1.73	141.00	-10.60	141.00	-19.10
2Y	137.50	147.45	18.02	-3.06	-5.23	137.50	-12.95	137.50	-25.15
3Y	135.75	147.20	17.03	-4.67	-6.25	135.75	-16.45	135.75	-19.50
4Y	134.75	154.75	10.37	-13.91	-15.28	134.75	-27.00	134.75	-30.35
5Y	134.00	155.00	9.72	-14.76	-15.47	134.00	-28.50	134.00	-28.50
7Y	133.50	163.95	1.42	-24.47	-24.13	133.50	-38.35	133.50	-38.35
10Y	136.00	170.00	-1.62	-26.96	-24.65	136.00	-40.70	136.00	-40.70
20Y	121.00	164.10	7.29	-28.39	-28.16	121.00	-48.45	121.00	-48.50

BASIS SWAP		CRS					USD/KRW		1178.90 (+0.80)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-69.00	4.25	1Y	0.7500	5.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-17.00	-2.00	
-77.00	3.00	1.5Y	0.6400	4.00	1.3950	1.1850	2*3Y	0.50	-0.50	
-79.50	2.25	2Y	0.5800	3.00	1.3750	1.1850	2*5Y	-1.50	-1.00	
-77.25	2.00	3Y	0.5850	2.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-0.50	0.00	
-76.75	1.75	4Y	0.5800	2.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-2.00	-0.50	
-77.50	1.00	5Y	0.5650	2.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-1.50	-0.50	
-70.50	1.25	7Y	0.6300	3.00	1.5750	0.0750	5*7Y	6.50	1.00	
-58.50	0.50	10Y	0.7750	2.50	1.7800	0.2550	5*10Y	21.00	0.50	

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	161.53	0.0046	1.6107	1.5777	1.5899	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.7731	-0.0026	1.7757	1.7491	1.7860	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	161.53	147.16	14.37	11.37	10.89	161.53	7.02	161.53	-108.00
10Y	177.31	167.74	9.57	8.31	6.10	177.31	-5.81	177.31	-24.46

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-1.50	1.25	-2.75	-2.75	-0.25	29.00	-9.50	52.75	-9.50
KTb 2*10Y	0.00	-21.30	21.30	20.20	24.40	55.50	0.00	68.70	0.00
UST 2*10Y	15.78	-0.72	16.50	17.14	19.61	34.56	-23.40	151.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y			SPRD	5*10y	1.75				
03Y	35.25			9*15y	-1.75				
04Y				10*15y	-3.2				
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y	20 / 20.5								
CRS	2y CCS 58								
	3y CCS 57								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	86 건		-35	121	168	148	58	83	104
금 액	22,305 억원		-13,430	35,735	50,018	47,975	17,418	18,469	41,210

장중동향
국고채 금리, 3년 제외한 전 구간 금리 상승하며 혼조 마감.

IRS, 이를 연속 전 구간 금리 상승 마감.

CRS, 금리 상승. 커브 플랫트닝.