

IPS Daily Morning Brief

2019-11-28

종가 기준일 2019-11-27

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4675	-1.50	1.4795	1.4779	1.4538	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4400	-2.25	1.4565	1.4535	1.4142	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4150	-2.75	1.4350	1.4329	1.3835	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3875	-2.75	1.4065	1.4086	1.3443	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3600	-3.00	1.3765	1.3853	1.3080	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3550	-2.50	1.3650	1.3828	1.2920	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3525	-2.50	1.3590	1.3830	1.2868	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3475	-2.25	1.3525	1.3846	1.2827	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3400	-2.50	1.3455	1.3841	1.2795	2.2050	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3600	-2.75	1.3690	1.4109	1.3075	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3550	-2.75	1.3620	1.4181	1.3200	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3375	-2.75	1.3415	1.4078	1.3104	2.3250	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2175	-2.75	1.2220	1.3044	1.2254	2.3400	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-2.75	-0.75	-2.30	-2.44	-3.96	7.25	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.50	-0.50	-2.15	-2.06	-3.07	5.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-5.50	-0.25	-5.85	-4.76	-7.55	14.00	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-0.50	0.50	-1.15	-0.25	-1.59	7.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-0.75	0.50	-1.75	-0.23	-2.12	13.00	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-1.25	0.75	-2.40	-0.06	-2.53	18.00	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	-0.25	0.00	-0.60	0.02	-0.53	6.00	-3.25	9.25	-3.25
3*5Y	-0.75	0.25	-1.25	0.19	-0.93	11.00	-5.25	18.00	-5.25
4*5Y	-0.50	0.25	-0.65	0.16	-0.40	5.00	-2.25	9.00	-2.25
5*7Y	-0.75	-0.25	-0.70	-0.05	-0.32	5.25	-1.75	12.50	-1.75
5*10Y	1.25	-0.50	1.65	2.63	2.48	12.25	0.50	26.75	0.50
7*10Y	2.00	-0.25	2.35	2.68	2.80	7.50	1.75	14.25	1.75
10*12Y	-0.50	0.00	-0.70	0.73	1.25	4.00	-1.00	6.75	-1.00
10*15Y	-2.25	0.00	-2.75	-0.31	0.29	6.75	-3.25	11.00	-3.25
10*20Y	-14.25	0.00	-14.70	-10.65	-8.21	9.75	-16.00	16.50	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.418	0.00	1.425	1.421	1.351	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.446	-0.60	1.456	1.472	1.387	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.450	-1.00	1.460	1.485	1.385	2.062	1.089	2.230	1.089
3Y	1.450	-1.70	1.462	1.498	1.380	2.127	0.092	2.315	0.092
4Y	1.523	-2.70	1.543	1.592	1.467	2.244	1.127	2.502	1.127
5Y	1.526	-3.10	1.550	1.604	1.465	2.370	1.122	2.602	1.122
7Y	1.604	-3.30	1.631	1.702	1.552	2.492	1.163	2.728	1.163
10Y	1.665	-3.50	1.694	1.761	1.589	2.585	1.170	2.815	1.170
20Y	1.605	-4.20	1.641	1.673	1.542	2.565	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	0.00
CALL	1.26	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.29	0.07	110.22	110.30	110.20
LKTb	130.56	0.37	130.23	130.61	130.13

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	-0.30	-2.75	1.04	1.19	3.27	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-5.85	-2.15	-4.97	-6.29	-4.32	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-9.00	-2.00	-8.33	-10.00	-7.75	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-9.50	-0.80	-9.72	-11.54	-8.78	92.30	-16.45	92.30	-19.50
4Y	-17.05	0.20	-18.38	-20.95	-18.01	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-17.85	0.85	-19.71	-21.93	-18.19	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-26.40	0.80	-28.57	-31.75	-27.22	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-30.50	0.75	-32.46	-35.04	-28.11	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-38.75	1.45	-41.90	-36.89	-31.70	52.25	-48.45	52.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1177.20 (+0.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-56.00	5.25	1Y	0.8550	2.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-21.00	0.00		
-65.25	5.25	1.5Y	0.7350	2.50	1.3950	1.1850	2*3Y	0.00	0.00		
-71.50	5.50	2Y	0.6450	2.50	1.3750	1.1850	2*5Y	-3.00	-0.50		
-71.00	5.00	3Y	0.6450	2.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-1.00	-0.50		
-71.75	4.50	4Y	0.6350	2.00	1.4600	0.0350	3*5Y	-3.00	-0.50		
-73.25	4.25	5Y	0.6150	2.00	1.5300	0.0150	4*5Y	-2.00	0.00		
-65.50	4.50	7Y	0.6850	2.00	1.5750	0.0750	5*7Y	7.00	0.00		
-55.00	4.75	10Y	0.8100	2.00	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	1.6195	0.0321	1.5874	1.6031	1.6153	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.7654	0.0206	1.7448	1.7568	1.7731	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	16.95	4.21	12.74	13.61	16.03	103.03	7.02	103.03	-108.00
10Y	10.04	5.56	4.48	3.18	7.51	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	0.00	0.25	-0.25	0.75	-1.50	29.00	-9.50	52.75	-9.50
KTb 2*10Y	21.50	-2.50	24.00	25.80	24.30	55.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	14.59	-1.15	15.74	15.37	15.78	34.56	-23.40	151.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	48									
09M										
01Y	42.25									
1.5Y	40.75									
02Y						1*3y -6.25				
03Y	35.75				SPRD					
04Y										
05Y	35 / 35.25 / 36.25									
07Y										
10Y	36.25									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	1.5y CCS 73 2y CCS 64 3y CCS 64 242y CCS 00									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	93 건	5	88	51	86	121	168	148		
금 액	31,385 억원	3,405	27,980	14,995	22,305	35,735	50,018	47,975		

장종동향
국고채 금리, 금투입 관망 속 외인 선물 매수 등 영향으로 금리 하락.

IRS, 전 구간 금리 하락.
오전부터 MBS 관련 물량 우려에 3-5년 구간으로 비드가 몰려.
국채선물 강세폭을 따라가지 못하는 모습.

CRS, 금리 상승 마감.