IPS Daily Morning Brief

2020-01-02

종가 기준일 2019-01-01

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4675	0.00	1.4660	1.4658	1.4547	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4300	0.00	1.4285	1.4298	1.4241	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4075	0.00	1.4060	1.4053	1.3998	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3675	0.00	1.3700	1.3770	1.3706	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3300	0.00	1.3340	1.3479	1.3420	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3225	0.00	1.3265	1.3444	1.3365	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3325	0.00	1.3365	1.3504	1.3384	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3350	0.00	1.3380	1.3518	1.3394	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3425	0.00	1.3460	1.3538	1.3398	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3825	0.00	1.3840	1.3858	1.3695	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4000	0.00	1.4015	1.3990	1.3803	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3825	0.00	1.3840	1.3811	1.3678	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2925	0.00	1.2850	1.2798	1.2722	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-3.75	0.00	-3.75	-3.60	-3.06	6.75	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.25	0.00	-2.25	-2.45	-2.43	4.75	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-7.75	0.00	-7.20	-5.74	-5.78	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-0.75	0.00	-0.75	-0.35	-0.55	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	0.25	0.00	0.25	0.25	-0.36	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	0.50	0.00	0.40	0.39	-0.26	15.00	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.00	0.00	1.00	0.60	0.19	5.25	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	1.25	0.00	1.15	0.74	0.29	9.00	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.25	0.00	0.15	0.14	0.10	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.75	0.00	0.80	0.20	0.04	5.00	-1.75	11.75	-1.75
5*10Y	4.75	0.00	4.60	3.40	3.01	12.25	0.50	24.75	0.50
7*10Y	4.00	0.00	3.80	3.20	2.98	7.50	1.75	13.25	1.75
10*12Y	1.75	0.00	1.75	1.33	1.08	4.00	-1.00	6.75	-1.00
10*15Y	0.00	0.00	0.00	-0.46	-0.18	6.00	-3.25	9.75	-3.25
10*20Y	-9.00	0.00	-9.90	-10.60	-9.73	7.25	-16.00	13.00	-16.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.366	0.00	1.375	1.377	1.379	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.365	0.00	1.377	1.398	1.413	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.357	0.00	1.371	1.395	1.416	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.355	100.00	1.162	1.235	1.368	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.465	0.00	1.468	1.478	1.510	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.470	0.00	1.471	1.477	1.514	2.287	1.122	2.602	1.122
7Y	1.608	0.00	1.603	1.589	1.617	2.415	1.163	2.728	1.163
10Y	1.672	0.00	1.659	1.648	1.671	2.517	1.170	2.815	1.170
20Y	1.702	0.00	1.676	1.630	1.632	2.485	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	0.00
CALL	1.32	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.54	0.00	110.52	110.58	110.51
LKTB	130.28	0.00	130.19	130.35	129.97

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	4.15	0.00	3.08	2.79	2.10	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	0.25	0.00	-0.72	-2.09	-4.21	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-2.70	0.00	-3.70	-4.75	-7.45	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-3.25	-100.00	16.45	10.94	-3.19	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-13.25	0.00	-13.13	-12.76	-17.14	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-13.50	0.00	-13.30	-12.52	-17.47	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-26.55	0.00	-25.70	-23.56	-27.76	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-28.95	0.00	-27.54	-26.24	-30.11	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-40.95	0.00	-39.06	-35.02	-35.93	52.25	-48.45	52.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-61.25	0.00
-62.75	0.00
-62.50	0.00
-60.75	0.00
-61.25	0.00
-58.50	0.00
-49.25	0.00
-43.75	0.00

CRS

USD/KRW 1156.40 (0.00)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.7950	0.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-9.00	0.00
1.5Y	0.7400	0.00	1.3950	0.1850	2*3Y	1.00	0.00
2Y	0.7050	0.00	1.3750	0.1800	2*5Y	4.50	0.00
3Y	0.7150	0.00	1.3800	0.0450	3*4Y	0.50	0.00
4Y	0.7200	0.00	1.4000	0.0350	3*5Y	3.50	0.00
5Y	0.7500	0.00	1.4600	0.0150	4*5Y	3.00	0.00
7Y	0.8500	0.00	1.5350	0.0750	5*7Y	10.00	0.00
10Y	0.9450	0.00	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	1.5770	0.0117	1.5653	1.5773	1.6330	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.9202	0.0369	1.8833	1.8780	1.8954	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	22.00	1.17	20.83	20.53	25.10	103.03	7.02	103.03	-104.00
10Y	24.82	3.69	21.13	19.60	25.64	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	5.25	0.00	5.25	5.50	4.50	27.00	-9.50	46.00	-9.50
KTB 2*10Y	31.50	0.00	31.50	31.00	25.70	52.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	34.32	2.52	31.80	30.07	26.24	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y		SPRD	
03Y			
04Y			
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	19 건	0	19	42	42	65	30	71
금 액	4,314 억원	0	4,314	13,125	9,350	29,775	9,906	38,380

장중동향

국고채 금리, 단기물 위주로 금리 하락하며 커브 스티프닝.
내년 장기채 중심 국채 발행 규모 확대 예정인 만큼 연말 윈도드레싱 효과가 그다지 나타나지 않음.

IRS, 1.5Y 이상 구간에서 금리 하락. 커브 플래트닝.
특별한 이벤트 없이 국채 현선물을 따라 움직이는 모양.

CRS, 전 구간 금리 상승. 커브 플래트닝.
결제일이 넘어가면서 오퍼 급감한 탓에 금리 급등.