IPS Daily Morning Brief

2019-12-19

종가 기준일 2019-12-18

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4725	0.25	1.4680	1.4681	1.4550	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4275	-0.75	1.4315	1.4373	1.4201	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4050	-0.75	1.4080	1.4123	1.3927	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3750	-1.25	1.3835	1.3859	1.3595	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3450	-1.50	1.3570	1.3586	1.3292	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3450	-1.50	1.3560	1.3539	1.3203	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3550	-1.25	1.3630	1.3539	1.3193	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3550	-1.50	1.3655	1.3521	1.3184	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3575	-1.00	1.3645	1.3489	1.3162	2.2050	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3900	-1.00	1.3970	1.3755	1.3444	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4075	-1.00	1.4125	1.3791	1.3546	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3925	-1.00	1.3955	1.3598	1.3430	2.3250	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3025	-0.75	1.3035	1.2485	1.2499	2.3400	0.9125	2.5600	0.9125
6*9M	-4.50	-1.00	-3.65	-3.09	-3.48	6.75	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.25	0.00	-2.35	-2.50	-2.75	5.00	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-6.00	-0.75	-5.10	-5.36	-6.35	14.00	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.00	0.00	-0.10	-0.48	-0.89	7.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	1.00	0.25	0.60	-0.48	-1.00	13.00	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	1.00	0.00	0.85	-0.65	-1.08	18.00	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.00	0.25	0.70	0.00	-0.10	6.00	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	1.00	0.00	0.95	-0.17	-0.19	11.00	-5.25	18.00	-5.25
4*5Y	0.00	-0.25	0.25	-0.17	-0.09	5.00	-2.25	9.00	-2.25
5*7Y	0.25	0.50	-0.10	-0.33	-0.22	5.25	-1.75	12.50	-1.75
5*10Y	3.50	0.50	3.15	2.34	2.60	12.25	0.50	26.75	0.50
7*10Y	3.25	0.00	3.25	2.66	2.82	7.50	1.75	14.25	1.75
10*12Y	1.75	0.00	1.55	0.36	1.02	4.00	-1.00	6.75	-1.00
10*15Y	0.25	0.00	-0.15	-1.58	-0.15	6.50	-3.25	10.00	-3.25
10*20Y	-8.75	0.25	-9.35	-12.70	-9.45	8.00	-16.00	13.00	-16.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.382	0.50	1.377	1.391	1.370	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.398	-0.40	1.406	1.420	1.404	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.395	0.00	1.402	1.420	1.406	2.062	1.089	2.230	1.089
3Y	1.360	100.30	0.973	1.315	1.373	2.127	0.092	2.315	0.092
4Y	1.460	-0.10	1.471	1.500	1.494	2.244	1.127	2.502	1.127
5Y	1.445	-0.50	1.464	1.503	1.497	2.370	1.122	2.602	1.122
7Y	1.567	0.20	1.573	1.596	1.594	2.492	1.163	2.728	1.163
10Y	1.610	1.00	1.616	1.659	1.643	2.585	1.170	2.815	1.170
20Y	1.592	1.70	1.588	1.618	1.600	2.565	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	0.00
CALL	1.28	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.49	0.02	110.46	110.52	110.43
LKTB	130.80	-0.16	130.72	130.91	130.56

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	2.30	-1.25	3.10	2.16	2.23	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-2.30	-0.85	-2.25	-3.38	-4.48	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-5.00	-1.50	-4.50	-6.15	-7.70	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-1.50	-101.80	38.32	3.89	-5.31	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-10.50	-1.15	-10.80	-14.56	-17.52	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-9.00	-1.00	-9.85	-15.10	-17.84	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-20.95	-1.20	-20.81	-24.73	-27.77	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-22.00	-2.00	-21.88	-28.31	-29.85	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-28.95	-2.45	-28.41	-36.95	-35.06	52.25	-48.45	52.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-59.00	0.25
-64.00	2.25
-67.00	5.00
-68.50	5.00
-71.00	5.75
-73.00	6.00
-64.25	5.00
-59.50	3.50

CRS

USD/KRW 1168.80 (+2.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8150	-0.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-14.00	4.00
1.5Y	0.7350	1.00	1.3950	1.1850	2*3Y	-1.50	0.00
2Y	0.6750	3.50	1.3750	1.1900	2*5Y	-5.00	1.00
3Y	0.6600	3.50	1.4100	0.0450	3*4Y	-1.50	1.00
4Y	0.6450	4.50	1.4600	0.0350	3*5Y	-3.50	1.00
5Y	0.6250	4.50	1.5300	0.0150	4*5Y	-2.00	0.00
7Y	0.7150	4.00	1.5750	0.0750	5*7Y	9.00	-0.50
10Y	0.7950	2.50	1.7800	0.2550	5*10Y	17.00	-2.00

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	1.6308	0.0002	1.6306	1.6304	1.6099	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.9214	0.0377	1.8837	1.8776	1.8271	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	23.58	0.02	23.56	23.04	18.99	103.03	7.02	103.03	-104.00
10Y	31.14	2.77	28.37	27.56	17.51	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	4.50	0.50	4.00	4.00	4.75	29.00	-9.50	52.75	-9.50
KTB 2*10Y	21.50	1.00	20.50	20.20	23.20	55.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	29.06	3.75	25.31	24.72	21.72	34.56	-23.40	151.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	40.5		
1.5Y			
02Y	34.5	SPRD	1*2y -5.75
03Y	34.25 / 34.75		
04Y			
05Y			
07Y	36		
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2y CCS 66 1.5y CCS 73		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	93 건	24	69	72	85	65	93	59
금 액	27,150 억원	10,350	16,800	17,145	27,008	14,605	55,568	11,455

장중동향

국고채, 눈치보기 장세 속 단기 금리 하락, 10Y 이상 장기 금리 상승하며 혼조 마감.
전일 공개된 금통위 의사록은 시장에 선반영된 측면이 강해 영향 제한적.

IRS, 대부분 구간에서 금리 하락.
전일 금통위의사록 공개 이후 기준금리 인하 기대로 추정되는 단기 리시브 다수.
CRS, 전 구간 금리 상승 마감. 커브 스티프닝.