

IPS Daily Morning Brief

2019-12-27

종가 기준일 2019-12-26

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4650	0.25	1.4645	1.4644	1.4541	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4275	0.25	1.4270	1.4299	1.4216	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4050	0.25	1.4045	1.4046	1.3959	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3725	0.50	1.3730	1.3775	1.3651	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3375	0.50	1.3415	1.3499	1.3358	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3300	0.50	1.3375	1.3470	1.3290	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3400	0.50	1.3490	1.3514	1.3298	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3400	0.50	1.3525	1.3521	1.3301	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3475	0.50	1.3605	1.3526	1.3296	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3825	0.50	1.3955	1.3821	1.3586	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3975	0.00	1.4145	1.3923	1.3692	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3775	-0.50	1.3985	1.3740	1.3570	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2625	-2.00	1.3010	1.2683	1.2623	2.3225	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-3.75	0.00	-3.75	-3.45	-3.25	6.75	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.25	0.00	-2.25	-2.53	-2.57	4.75	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-6.75	0.25	-6.30	-5.48	-6.01	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-0.75	0.00	-0.40	-0.29	-0.68	6.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	0.25	0.00	0.75	0.15	-0.61	12.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	0.25	0.00	1.10	0.23	-0.57	17.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.00	0.00	1.15	0.44	0.08	5.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	1.00	0.00	1.50	0.51	0.11	10.75	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.00	0.00	0.35	0.08	0.04	5.00	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.75	0.00	0.80	0.05	-0.05	5.25	-1.75	11.75	-1.75
5*10Y	4.25	0.00	4.30	3.00	2.85	12.25	0.50	24.75	0.50
7*10Y	3.50	0.00	3.50	2.95	2.90	7.50	1.75	13.25	1.75
10*12Y	1.50	-0.50	1.90	1.01	1.05	4.00	-1.00	6.75	-1.00
10*15Y	-0.50	-1.00	0.30	-0.81	-0.16	6.00	-3.25	9.75	-3.25
10*20Y	-12.00	-2.50	-9.45	-11.39	-9.64	7.25	-16.00	13.00	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.380	-1.00	1.386	1.381	1.375	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.387	-0.80	1.396	1.405	1.408	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.382	-0.50	1.394	1.404	1.412	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.365	-0.40	1.375	1.293	1.379	2.092	0.092	2.315	0.092
4Y	1.467	0.10	1.474	1.482	1.502	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.470	1.00	1.466	1.482	1.505	2.335	1.122	2.602	1.122
7Y	1.593	0.80	1.594	1.587	1.606	2.465	1.163	2.728	1.163
10Y	1.639	0.70	1.647	1.647	1.658	2.565	1.170	2.815	1.170
20Y	1.645	1.30	1.645	1.619	1.617	2.552	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	0.00
CALL	1.31	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.54	0.01	110.53	110.56	110.48
LKTb	130.55	-0.05	130.69	130.69	130.42

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	2.50	1.25	1.87	2.36	2.12	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-1.45	1.30	-2.34	-2.72	-4.32	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-4.45	1.00	-5.27	-5.38	-7.57	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-3.50	0.90	-3.77	5.38	-5.05	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-12.70	0.40	-12.50	-13.09	-17.24	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-13.00	-0.50	-11.33	-13.00	-17.51	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-24.55	-0.30	-23.35	-23.42	-27.68	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-25.65	-0.20	-25.11	-26.47	-29.93	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-38.25	-3.30	-34.38	-35.07	-35.48	52.25	-48.45	52.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1161.80 (-2.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-61.50	-1.25	1Y	0.7900	-1.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-11.50	1.50		
-65.25	-0.50	1.5Y	0.7200	0.00	1.3950	1.1850	2*3Y	-1.00	0.00		
-66.25	0.00	2Y	0.6750	0.50	1.3750	1.1900	2*5Y	-2.00	0.00		
-66.50	0.00	3Y	0.6650	0.50	1.3850	0.0450	3*4Y	-1.50	0.00		
-69.00	0.00	4Y	0.6500	0.50	1.4200	0.0350	3*5Y	-1.00	0.00		
-68.50	0.00	5Y	0.6550	0.50	1.4800	0.0150	4*5Y	0.50	0.00		
-59.25	0.00	7Y	0.7550	0.50	1.5350	0.0750	5*7Y	10.00	0.00		
-53.25	0.00	10Y	0.8500	0.50	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	1.6330	0.0040	1.6290	1.6564	1.6356	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.8954	-0.0070	1.9024	1.9295	1.9181	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	25.10	0.9	24.20	25.94	23.06	103.03	7.02	103.03	-104.00
10Y	25.64	-1.40	27.04	28.75	25.31	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	4.50	0.00	4.50	5.50	6.75	29.00	-9.50	46.00	-9.50
KTb 2*10Y	25.70	1.20	24.50	24.50	26.00	55.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	26.24	-1.10	27.34	27.31	28.25	34.56	-23.40	149.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	33.5	SPRD	1*6y -6.5						
03Y			10*12y 2						
04Y	34								
05Y									
07Y	34.5								
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	42 건	-23	65	30	71	104	93	69	
금 액	9,350 억원	-20,425	29,775	9,906	38,380	34,462	27,150	16,800	

장중동향
국고채 금리, 1월 국채발행계획 앞두고 단기 금리 하락, 장기 금리 상승. 커브 스티프닝.

IRS, 전 구간 금리 상승.
연말 장세 속 거래 거의 없이 현물에 연동되는 모습.

CRS, 2Y 이상 구간에서 금리 상승하며 혼조세.