IPS Daily Morning Brief

2020-01-03

종가 기준일 2020-01-02

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4550	-1.25	1.4645	1.4653	1.4546	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4050	-2.50	1.4245	1.4281	1.4244	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3775	-3.00	1.4010	1.4036	1.4006	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3325	-3.50	1.3630	1.3745	1.3717	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2925	-3.75	1.3260	1.3446	1.3433	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2825	-4.00	1.3180	1.3406	1.3382	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2950	-3.75	1.3285	1.3471	1.3405	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3000	-3.50	1.3310	1.3488	1.3418	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3075	-3.50	1.3390	1.3510	1.3425	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3475	-3.50	1.3780	1.3836	1.3725	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3550	-4.50	1.3930	1.3974	1.3832	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3475	-3.50	1.3770	1.3801	1.3707	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2550	-3.75	1.2795	1.2803	1.2749	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-5.00	-1.25	-4.00	-3.71	-3.02	6.75	-9.00	12.50	-9.00
9*12M	-2.75	-0.50	-2.35	-2.45	-2.38	4.75	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-8.50	-0.75	-7.50	-5.90	-5.73	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-1.00	-0.25	-0.80	-0.40	-0.51	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	0.25	0.00	0.25	0.25	-0.28	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	0.75	0.25	0.50	0.41	-0.15	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.25	0.25	1.05	0.65	0.23	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	1.75	0.50	1.30	0.81	0.36	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.50	0.25	0.25	0.16	0.13	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.75	0.00	0.80	0.22	0.07	4.75	-1.75	11.25	-1.75
5*10Y	4.75	0.00	4.70	3.49	3.07	12.25	0.50	24.00	0.50
7*10Y	4.00	0.00	3.90	3.26	3.00	7.50	1.75	13.25	1.75
10*12Y	0.75	-1.00	1.50	1.38	1.07	4.00	-1.00	6.75	-1.00
10*15Y	0.00	0.00	-0.10	-0.35	-0.18	5.50	-3.25	9.75	-3.25
10*20Y	-9.25	-0.25	-9.85	-10.34	-9.76	6.50	-16.00	13.00	-16.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.341	-2.50	1.365	1.375	1.380	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.340	-2.50	1.366	1.394	1.414	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.330	-2.70	1.360	1.390	1.417	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.322	-3.30	1.153	1.228	1.369	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.425	-4.00	1.460	1.473	1.511	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.430	-4.00	1.465	1.471	1.516	2.285	1.122	2.602	1.122
7Y	1.566	-4.20	1.599	1.585	1.620	2.400	1.163	2.728	1.163
10Y	1.625	-4.70	1.658	1.643	1.674	2.497	1.170	2.815	1.170
20Y	1.665	-3.70	1.682	1.628	1.636	2.462	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.53	0.00
CALL	1.30	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.66	0.12	110.52	110.68	110.49
LKTB	130.70	0.42	130.06	130.80	129.90

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	3.65	-0.50	3.56	2.83	2.09	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-0.75	-1.00	-0.32	-1.96	-4.19	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-3.75	-1.05	-3.36	-4.55	-7.41	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-3.95	-0.70	16.54	11.23	-3.12	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-13.00	0.25	-13.11	-12.54	-17.10	-4.50	-27.00	-1.45	-30.35
5Y	-13.00	0.50	-13.40	-12.23	-17.44	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-25.85	0.70	-26.02	-23.43	-27.78	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-27.75	1.20	-28.00	-25.89	-30.15	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-41.00	-0.05	-40.27	-34.82	-36.08	52.25	-48.45	52.25	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-55.25	6.00
-57.75	5.00
-58.75	3.75
-56.75	4.00
-57.00	4.25
-54.50	4.00
-45.75	3.50
-40.25	3.50

CRS

USD/KRW 1158.10 (+1.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8250	3.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-12.00	-3.00
1.5Y	0.7550	1.50	1.3950	1.1850	2*3Y	1.00	0.00
2Y	0.7050	0.00	1.3750	1.1800	2*5Y	5.00	0.50
3Y	0.7150	0.00	1.3800	0.0450	3*4Y	1.00	0.50
4Y	0.7250	0.50	1.4000	0.0350	3*5Y	4.00	0.50
5Y	0.7550	0.50	1.4550	0.0150	4*5Y	3.00	0.00
7Y	0.8500	0.00	1.5350	0.0750	5*7Y	9.50	-0.50
10Y	0.9450	0.00	1.7800	0.2550	5*10Y	19.00	-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	1.5730	-0.0040	1.5770	1.5653	1.5773	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.8772	-0.0430	1.9202	1.8833	1.8780	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	24.30	2.3	22.00	20.83	20.53	103.03	7.02	103.03	-104.00
10Y	25.22	0.40	24.82	21.13	19.60	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	5.50	0.25	5.25	5.25	5.50	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTB 2*10Y	29.50	-2.00	31.50	31.50	31.00	50.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	30.42	-3.90	34.32	31.80	30.07	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	32	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	69 건	50	19	19	42	42	65	30
금 액	22,737 억원	18,423	4,314	4,314	13,125	9,350	29,775	9,906

장중동향

국고채 금리, 연초를 맞아 단기물 중심 강세를 보이며 금리 하락.

IRS, 전 구간 금리 하락.
이주열 한은 총재가 올해도 완화적 통화정책 기조 이어가겠단 뜻을 밝히며 금리 인하 기대 확산.
2-3년 구간을 중심으로 오퍼 유입.

CRS, 전 구간 금리 상승 마감.