

IPS Daily Morning Brief

2020-01-13

종가 기준일 2020-01-10

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4250	-4.25	1.4380	1.4581	1.4546	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4175	7.50	1.3840	1.4153	1.4251	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4100	0.50	1.3740	1.3948	1.4043	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4000	1.75	1.3490	1.3643	1.3781	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3875	3.25	1.3255	1.3341	1.3515	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3950	4.25	1.3200	1.3290	1.3485	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.4100	5.75	1.3245	1.3369	1.3520	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.4150	6.50	1.3235	1.3388	1.3537	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.4200	7.25	1.3255	1.3430	1.3553	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.4550	8.25	1.3580	1.3778	1.3860	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4725	9.25	1.3735	1.3941	1.3969	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.4500	9.00	1.3530	1.3769	1.3834	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3525	10.50	1.2530	1.2811	1.2855	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-0.75	11.75	-5.40	-4.29	-2.95	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-0.75	-7.00	-1.00	-2.05	-2.09	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-2.25	2.75	-4.85	-6.06	-5.27	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.75	1.00	-0.55	-0.51	-0.30	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	2.25	2.50	-0.10	0.27	0.05	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	2.75	3.25	-0.20	0.46	0.21	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.50	1.50	0.45	0.79	0.35	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	2.00	2.25	0.35	0.98	0.52	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.50	0.75	-0.10	0.19	0.17	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.50	0.75	0.20	0.42	0.17	4.75	-1.75	10.75	-1.75
5*10Y	4.00	1.75	3.45	3.90	3.23	12.25	0.50	24.00	0.50
7*10Y	3.50	1.00	3.25	3.48	3.07	7.50	1.75	13.25	1.75
10*12Y	1.75	1.00	1.55	1.64	1.09	4.00	-1.00	6.50	-1.00
10*15Y	-0.50	0.75	-0.50	-0.09	-0.26	5.50	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-10.25	2.25	-10.50	-9.66	-10.05	6.50	-16.00	13.00	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.339	0.80	1.321	1.359	1.383	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.373	1.70	1.341	1.374	1.416	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.415	1.50	1.365	1.376	1.423	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.417	0.20	1.363	1.211	1.376	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.533	1.70	1.462	1.462	1.520	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.555	3.00	1.469	1.461	1.526	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.678	3.00	1.598	1.586	1.633	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.708	2.30	1.643	1.637	1.689	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.697	2.40	1.649	1.639	1.653	2.430	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.46	0.00
CALL	1.28	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.26	-0.06	110.36	110.41	110.24
LKTb	129.25	-0.43	129.86	129.95	129.19

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	7.10	-0.30	5.34	3.58	2.17	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	2.70	0.05	0.78	-0.94	-3.84	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-2.75	1.75	-3.99	-4.16	-7.19	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-2.20	4.05	-4.26	11.79	-2.74	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-12.30	4.05	-13.79	-12.50	-16.82	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-14.00	3.50	-14.55	-12.18	-17.24	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-25.80	4.25	-27.23	-24.33	-27.80	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-25.30	5.95	-28.54	-25.93	-30.28	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-34.45	8.10	-39.64	-35.81	-36.75	52.25	-48.45	52.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1161.30 (+1.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-59.00	-0.50	1Y	0.8200	0.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-12.00	1.00		
-65.00	-2.25	1.5Y	0.7500	-0.50	1.3950	1.1850	2*3Y	4.00	0.50		
-68.75	-2.25	2Y	0.7000	1.00	1.3750	1.1800	2*5Y	11.50	0.50		
-65.50	-2.75	3Y	0.7400	1.50	1.3800	0.0450	3*4Y	3.50	0.50		
-63.50	-3.75	4Y	0.7750	2.00	1.4000	0.0350	3*5Y	7.50	0.00		
-60.00	-5.00	5Y	0.8150	1.50	1.4550	0.0150	4*5Y	4.00	-0.50		
-54.50	-5.75	7Y	0.8750	1.50	1.5350	0.0750	5*7Y	6.00	0.00		
-48.50	-6.75	10Y	0.9700	1.50	1.7800	0.2550	5*10Y	15.50	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	1.5762	-0.0083	1.5845	1.5806	1.5444	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.8224	-0.0376	1.8600	1.8739	1.8231	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	16.12	-2.33	18.45	21.56	19.74	103.03	7.02	103.03	-104.00
10Y	11.44	-6.06	17.50	23.89	19.11	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	6.75	5.00	1.75	2.75	3.75	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTb 2*10Y	29.30	0.80	28.50	27.00	28.50	48.30	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	24.62	-2.93	27.55	29.33	27.87	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M									
09M	41								
01Y	40.75								
1.5Y	40								
02Y	37.5 / 38.5		SPRD	6*9m -1.25 / -1					
03Y				2*5y 2.25					
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	146 건	7	139	83	136	127	138	69	
금 액	65,942 억원	-7,703	73,645	45,485	54,740	50,221	43,733	22,737	

장중동향

국고채 금리, 약세장 연속에 투자심리 약화되며 금리 상승.

IRS, 전 구간 금리 급등 마감. 커브 스티프닝.

CRS, 전 구간 금리 상승.