

IPS Daily Morning Brief

2020-01-15

종가 기준일 2020-01-14

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4175	-0.50	1.4330	1.4534	1.4565	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4075	-0.50	1.3955	1.4129	1.4270	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3975	-0.75	1.3965	1.3940	1.4064	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3825	-1.00	1.3805	1.3641	1.3804	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3650	-1.50	1.3625	1.3349	1.3543	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3700	-1.75	1.3640	1.3305	1.3515	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3850	-1.75	1.3735	1.3394	1.3555	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3875	-1.75	1.3745	1.3411	1.3573	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3925	-1.75	1.3775	1.3461	1.3590	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.4250	-2.00	1.4100	1.3810	1.3898	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4400	-2.00	1.4245	1.3976	1.4007	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.4200	-2.00	1.4040	1.3804	1.3868	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3275	-1.50	1.3050	1.2844	1.2883	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-1.00	0.00	-3.75	-4.05	-2.94	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-1.00	-0.25	0.10	-1.89	-2.06	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-3.25	-0.75	-3.40	-5.91	-5.22	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.50	-0.25	0.15	-0.44	-0.28	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	2.00	-0.25	1.10	0.45	0.12	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	2.25	-0.25	1.20	0.63	0.30	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.50	0.00	0.95	0.89	0.40	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	1.75	0.00	1.05	1.06	0.58	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.25	0.00	0.10	0.18	0.18	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.50	0.00	0.30	0.50	0.17	4.75	-1.75	10.75	-1.75
5*10Y	3.75	-0.25	3.55	3.99	3.25	12.25	0.50	24.00	0.50
7*10Y	3.25	-0.25	3.25	3.49	3.08	7.50	1.75	13.25	1.75
10*12Y	1.50	0.00	1.45	1.66	1.09	4.00	-1.00	6.50	-1.00
10*15Y	-0.50	0.00	-0.60	-0.06	-0.30	5.50	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-9.75	0.50	-10.50	-9.66	-10.15	6.50	-16.00	13.00	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.336	-0.20	1.332	1.355	1.384	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.368	-0.60	1.362	1.369	1.417	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.384	-1.60	1.393	1.374	1.424	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.388	-1.80	1.398	1.212	1.377	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.480	-3.50	1.501	1.463	1.522	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.512	-3.00	1.520	1.465	1.528	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.642	-2.60	1.645	1.593	1.637	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.715	-1.70	1.695	1.646	1.693	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.720	-0.20	1.690	1.651	1.658	2.430	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.46	0.00
CALL	1.27	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.45	0.12	110.30	110.45	110.28
LKTb	129.68	0.30	129.27	129.70	129.12

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	6.15	-0.55	6.45	3.91	2.27	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	1.45	-0.40	1.85	-0.52	-3.69	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-1.90	0.10	-3.03	-3.91	-7.02	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-1.80	0.05	-3.44	11.87	-2.50	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-9.50	1.75	-12.71	-12.38	-16.61	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-12.45	1.25	-14.53	-12.36	-17.11	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-24.95	0.85	-26.77	-24.70	-27.77	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-29.00	-0.30	-28.50	-26.50	-30.36	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-39.25	-1.30	-38.54	-36.68	-36.97	52.25	-48.45	52.25	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1156.10 (+0.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-57.25	0.25	1Y	0.8250	-0.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-9.00	2.50		
-59.75	2.50	1.5Y	0.7850	1.50	1.3950	1.1850	2*3Y	5.00	0.00		
-63.00	3.50	2Y	0.7350	2.00	1.3750	1.1800	2*5Y	12.50	-1.00		
-58.50	3.75	3Y	0.7850	2.00	1.3800	0.0450	3*4Y	3.50	0.00		
-56.50	3.75	4Y	0.8200	2.00	1.4000	0.0350	3*5Y	7.50	-1.00		
-52.75	2.75	5Y	0.8600	1.00	1.4550	0.0150	4*5Y	4.00	-1.00		
-47.25	2.75	7Y	0.9200	1.00	1.5350	0.0750	5*7Y	6.00	0.00		
-41.00	3.00	10Y	1.0150	1.00	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	1.5680	-0.0244	1.5924	1.5762	1.5845	2.9773	1.3841	2.9773	0.5500
10Y	1.8137	-0.0367	1.8504	1.8224	1.8600	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	18.40	-0.84	19.24	16.12	18.45	103.03	7.02	103.03	-104.00
10Y	9.87	-1.97	11.84	11.44	17.50	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	6.00	-0.50	6.50	6.75	1.75	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTb 2*10Y	33.10	-0.10	33.20	29.30	28.50	48.30	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	24.57	-1.23	25.80	24.62	27.55	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	39.75								
1.5Y									
02Y	36.75 / 37.25 / 39.5	SPRD	5*10y 4						
03Y	39.5								
04Y									
05Y	39.2 / 39.5 / 41.25 / 41.75 / 42 / 42.25								
07Y									
10Y	43.5 / 45.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2*3y CCS 5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	115 건	14	101	146	139	83	136	127	
금 액	34,550 억원	-14,034	48,584	65,942	73,645	45,485	54,740	50,221	

장중동향
국고채 금리, 금통위 앞두고 단기 구간 중심 배팅성 매수 유입 등으로 금리 하락 마감.

IRS, 최근 금리 상승에 대한 되돌림으로 전 구간 금리 하락. 커브 플랫트닝.

CRS, 전 구간 금리 상승 마감.