

IPS Daily Morning Brief

2020-01-21

종가 기준일 2020-01-20

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4325	-3.50	1.4360	1.4479	1.4610	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4225	-1.00	1.4205	1.4116	1.4313	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4125	0.75	1.4060	1.3941	1.4110	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.4100	2.75	1.3930	1.3673	1.3857	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.4075	5.25	1.3780	1.3408	1.3603	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.4175	6.50	1.3815	1.3371	1.3577	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.4325	8.00	1.3910	1.3458	1.3615	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.4425	9.25	1.3935	1.3475	1.3629	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.4475	10.00	1.3955	1.3524	1.3641	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.4775	10.50	1.4235	1.3861	1.3941	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4925	11.25	1.4370	1.4018	1.4048	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.4750	11.50	1.4175	1.3836	1.3901	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3975	15.00	1.3260	1.2876	1.2903	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-1.00	2.50	-1.55	-3.63	-2.97	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-1.00	1.75	-1.45	-1.75	-2.03	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-0.50	4.50	-2.80	-5.34	-5.07	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	1.00	1.25	0.35	-0.36	-0.26	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	2.50	2.75	1.30	0.50	0.12	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	3.50	4.00	1.55	0.68	0.26	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.50	1.50	0.95	0.86	0.38	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	2.50	2.75	1.20	1.04	0.52	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	1.00	1.25	0.25	0.18	0.14	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.50	0.75	0.20	0.49	0.12	4.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	3.50	1.25	3.00	3.86	3.12	12.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.00	0.50	2.80	3.38	3.00	7.50	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.50	0.75	1.35	1.56	1.07	4.00	-1.00	6.50	-1.00
10*15Y	-0.25	1.00	-0.60	-0.25	-0.40	5.25	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-8.00	4.50	-9.75	-9.85	-10.38	6.25	-16.00	13.00	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.361	1.50	1.345	1.349	1.385	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.412	2.30	1.386	1.367	1.418	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.444	3.20	1.410	1.378	1.427	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.452	3.00	1.416	1.323	1.379	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.535	2.90	1.500	1.471	1.523	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.577	3.20	1.535	1.482	1.531	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.689	1.80	1.655	1.610	1.640	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.756	1.60	1.722	1.668	1.698	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.760	2.70	1.722	1.677	1.662	2.430	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.46	0.00
CALL	1.27	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.20	-0.10	110.26	110.27	110.14
LKTb	129.38	-0.09	129.26	129.43	129.03

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 반영평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	5.15	-0.75	6.10	4.54	2.62	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-0.20	0.45	0.66	-0.01	-3.26	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-3.65	2.05	-3.24	-3.71	-6.67	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-3.45	3.50	-3.41	1.40	-2.10	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-10.25	5.10	-10.92	-12.52	-16.12	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-13.45	6.05	-14.13	-13.46	-16.83	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-24.15	8.20	-25.95	-25.80	-27.61	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-27.85	8.90	-29.89	-28.14	-30.43	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-36.25	12.30	-39.56	-38.89	-37.20	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1158.10 (-6.36)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-54.25	0.75	1Y	0.8700	1.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-6.00	0.50		
-57.00	-1.25	1.5Y	0.8400	1.50	1.3950	1.1950	2*3Y	3.50	0.50		
-59.75	-3.25	2Y	0.8100	2.00	1.3750	1.1750	2*5Y	5.50	1.00		
-57.25	-4.00	3Y	0.8450	2.50	1.3800	0.0450	3*4Y	1.00	0.50		
-57.75	-5.00	4Y	0.8550	3.00	1.4000	0.0350	3*5Y	2.00	0.50		
-57.75	-6.25	5Y	0.8650	3.00	1.4550	0.0150	4*5Y	1.00	0.00		
-54.75	-9.50	7Y	0.9000	0.50	1.5350	0.0750	5*7Y	3.50	-2.50		
-48.25	-10.00	10Y	0.9950	0.50	1.7800	0.2550	5*10Y	13.00	-2.50		

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	1.5633	0.0000	1.5633	1.5800	1.5475	2.9773	1.3841	2.9773	0.5600
10Y	1.8234	0.0000	1.8234	1.8120	1.7866	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	11.93	-3.2	15.13	16.50	15.05	103.03	7.02	103.03	-102.70
10Y	6.74	-1.60	8.34	10.70	9.06	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	7.00	5.25	1.75	3.50	4.50	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTb 2*10Y	31.20	-1.60	32.80	29.00	29.90	45.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	26.01	0.00	26.01	23.20	23.91	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y			SPRD						
03Y	44								
04Y	46								
05Y									
07Y	47.75								
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	140 건	16	124	127	124	115	101	146	
금 액	44,490 억원	4,035	40,455	58,682	49,417	34,550	48,584	65,942	

장중동향

국고채 금리, 지난주 금통위 이후 기준금리 인하 기대감 후퇴하면서 심리 위축되어 금리 상승.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.

CRS, 전 구간 금리 상승.