IPS Daily Morning Brief

2020-01-23

종가 기준일 2020-01-21

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4225	-1.00	1.4370	1.4458	1.4613	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.4075	-1.50	1.4205	1.4106	1.4315	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.4000	-1.25	1.4065	1.3939	1.4113	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3900	-2.00	1.3945	1.3680	1.3861	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3825	-2.50	1.3815	1.3425	1.3611	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3900	-2.75	1.3855	1.3393	1.3587	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.4050	-2.75	1.3950	1.3480	1.3628	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.4100	-3.25	1.3980	1.3496	1.3642	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.4175	-3.00	1.4005	1.3544	1.3655	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.4475	-3.00	1.4280	1.3878	1.3954	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.4625	-3.00	1.4415	1.4031	1.4060	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.4450	-3.00	1.4225	1.3849	1.3911	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.3725	-2.50	1.3350	1.2898	1.2913	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-1.50	-0.50	-1.65	-3.51	-2.97	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-0.75	0.25	-1.40	-1.68	-2.02	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-1.75	-1.25	-2.50	-5.14	-5.03	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.75	-0.25	0.40	-0.33	-0.24	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	2.25	-0.25	1.35	0.55	0.17	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	2.75	-0.75	1.65	0.71	0.31	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.50	0.00	0.95	0.88	0.41	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	2.00	-0.50	1.25	1.04	0.55	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.50	-0.50	0.30	0.16	0.14	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.75	0.25	0.25	0.47	0.13	4.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	3.75	0.25	3.00	3.81	3.12	12.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.00	0.00	2.75	3.34	2.99	7.50	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.50	0.00	1.35	1.54	1.07	4.00	-1.00	6.50	-1.00
10*15Y	-0.25	0.00	-0.55	-0.29	-0.42	5.25	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-7.50	0.50	-9.30	-9.80	-10.40	6.25	-16.00	13.00	-16.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.341	-2.00	1.346	1.347	1.384	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.382	-3.00	1.389	1.367	1.418	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.397	-4.70	1.413	1.377	1.426	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.400	-5.20	1.418	1.324	1.378	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.475	-6.00	1.499	1.470	1.522	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.517	-6.00	1.536	1.484	1.531	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.626	-6.30	1.652	1.611	1.640	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.692	-6.40	1.718	1.669	1.699	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.715	-4.50	1.721	1.680	1.663	2.430	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.46	0.00
CALL	1.29	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.39	0.19	110.18	110.42	110.15
LKTB	130.10	0.72	129.39	130.23	129.29

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	5.90	0.75	6.05	4.74	2.71	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	0.80	1.00	0.53	0.14	-3.15	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-1.45	2.20	-3.15	-3.50	-6.54	-0.25	-12.95	-0.25	-25.15
3Y	-1.00	2.45	-3.25	1.54	-1.93	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-7.00	3.25	-10.42	-12.24	-15.89	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-10.70	2.75	-13.78	-13.45	-16.66	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-20.85	3.30	-25.13	-25.69	-27.43	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-24.45	3.40	-28.98	-28.11	-30.32	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-34.25	2.00	-38.56	-38.98	-37.15	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-56.50	-2.25
-57.50	-0.50
-58.75	1.00
-57.00	0.25
-57.00	0.75
-56.50	1.25
-53.75	1.00
-51.75	-3.50

CRS

USD/KRW 1167.00 (+8.90)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.8350	-3.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-4.00	2.00
1.5Y	0.8150	-2.50	1.3950	1.1800	2*3Y	2.50	-1.00
2Y	0.7950	-1.50	1.3750	1.1600	2*5Y	5.00	-0.50
3Y	0.8200	-2.50	1.3800	0.0450	3*4Y	1.50	0.50
4Y	0.8350	-2.00	1.4000	0.0350	3*5Y	2.50	0.50
5Y	0.8450	-2.00	1.4550	0.0150	4*5Y	1.00	0.00
7Y	0.8800	-2.00	1.5350	0.0750	5*7Y	3.50	0.00
10Y	0.9300	-6.50	1.7800	0.2550	5*10Y	8.50	-4.50

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	1.5263	-0.0370	1.5633	1.5633	1.5800	2.9773	1.3841	2.9773	0.5600
10Y	1.7710	-0.0524	1.8234	1.8234	1.8120	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	12.93	1	11.93	15.13	16.50	103.03	7.02	103.03	-102.70
10Y	7.90	1.16	6.74	8.34	10.70	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	6.50	-0.50	7.00	1.75	3.50	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTB 2*10Y	29.50	-1.70	31.20	32.80	29.00	45.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	24.47	-1.54	26.01	26.01	23.20	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y		SPRD	4*5y 0.75
03Y	40.75 / 41.5 / 43 / 43.25		
04Y			
05Y	43.5 / 45.5		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	5y CCS 80.5 / 81.5 / 82 2*4y CCS 3.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	132 건	-8	140	124	127	124	115	101
금 액	45,562 억원	1,072	44,490	40,455	58,682	49,417	34,550	48,584

장중동향

국고채 금리, 되돌림 압력에 금리 상승...GDP 호조

IRS, 금리 전 구간 상승...국채선물 연동

CRS, 금리 전 구간 하락.