BONDWEB DAILY

# 본드웹 데일리

## 주요 국내채권금리

| 종목 | 01/14 | 전일비(bp) | 전주비(bp) | 기준금리비(bp) |
|---|---|---|---|---|
| CD91 | 0.670 | 0.00 | +1.00 | +17.00 |
| 통안2Y | 0.883 | +0.30 | 0.00 | +38.30 |
| 국고3Y | 0.988 | +0.90 | +1.00 | +48.80 |
| 국고5Y | 1.324 | +1.40 | -0.20 | +82.40 |
| 국고10Y | 1.734 | +1.50 | +0.50 | +123.40 |
| 국고20Y | 1.817 | +1.40 | -0.10 | +131.70 |
| 공사AAA 5Y | 1.456 | -0.50 | -1.70 | +95.60 |
| 회사AA-3Y | 2.155 | -0.30 | -2.30 | +165.50 |
| 회사BBB-3Y | 8.560 | -0.20 | -2.50 | +806.00 |

*출처 : 금투협 최종호가수익률 (공사채는 본드웹[2051])

## 해외금리

| 종목 | 01/13 | 전일비(bp) | 전주비(bp) | 美국채대비(bp) |
|---|---|---|---|---|
| $ LIBOR 6M | 0.248 | +0.03 | +0.14 | - |
| 미국2Y | 0.149 | +0.40 | +1.20 | - |
| 독일2Y | -0.707 | -2.05 | -0.77 | -85.62 |
| 영국2Y | -0.043 | -3.16 | +1.72 | -19.23 |
| 일본2Y | -0.125 | -0.19 | -0.41 | -27.39 |
| 미국10Y | 1.088 | -4.67 | -3.29 | - |
| 독일10Y | -0.518 | -5.31 | +3.27 | -160.51 |
| 영국10Y | 0.309 | -4.55 | +2.14 | -77.84 |
| 일본10Y | 0.032 | -0.52 | -0.74 | -105.59 |

*전일종가 (휴장국가는 전영업일)

## 금리선물

| 종목 | 01/14 | 전일대비(Tick) | 전주대비(Tick) | 고/저평 | 거래량(계약) | 전일비(계약) | 미결제약정 | 전일비(계약) | 수정듀레이션 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| KTB F 202012 | 111.66 | +4 | +14 | +11163 | 121,117 | +21,670 | 376,469 | -847 | 2.8196 |
| LKTB F 202012 | 131.01 | +19 | +131 | +13087 | 58,882 | +1,855 | 157,153 | -738 | 8.262 |

## Swap Point

| 종목 | 01/14 | 전일비(%) | IRS-BOND(bp) | 종목 | 01/14 | IRS-BOND | CRS-BOND | CRS-IRS |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IRS2Y | 0.8930 | ▲0.03 | 2Y | CRS2Y | 0.1950 | ▲0.195 | -66.50 | +0.77 |
| IRS3Y | 0.9900 | ▲0.03 | 3Y | CRS3Y | 0.2300 | ▲0.23 | -75.50 | +0.84 |
| IRS5Y | 1.1330 | ▲0.015 | 5Y | CRS5Y | 0.3100 | ▲0.31 | -101.40 | +1.12 |
| IRS10Y | 1.3080 | ▲0.0175 | 10Y | CRS10Y | 0.6550 | ▲0.655 | -107.70 | +1.41 |

출처 : Prebon 4시 기준

## Stock & FX

| 종목 | 01/14 | 전일비 | 8.216 | 종목 | 01/14 | 전일비(원) | 종목 | 01/14 | 전일비 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| KOSPI | 3149.93 | +1.64 | +0.05 | USD/KRW | 1095.00 | -4.90 | EUR/USD | 1.2165 | +0.0015 |
| KOSDAQ | 980.29 | +980.29 | +0.12 | NDF 1M | 1098.00 | +5.00 | USD/JPY | 103.8650 | +0.0700 |

*출처 : KRX(주가), 서울외국환중개(외환), TPI(NDF), NDF 및 이종통화는 오후 4시 기준

# Economic Indicators

### 01월 14일 만기 및 발행스케줄

만기 1조 6781억

한국토지주택공사 무보증(AAA) 10년 -3.00bp 2500억 낙찰

### 01월 15일 만기 및 발행스케줄

만기 1조 7371억

국고채 교환 예정 2000억

한은RP 환매수 17조

### 01월 14일 경제일정

美 주간 실업수당 청구건수

美 12월 수출입물가

韓 2020년 12월 수출입물가지수

韓 코스피200옵션 2101, 미니 코스피200선물/옵션 2101

### 01월 15일 경제일정

美 12월 생산자물가

美 12월 소매판매

美 1월 NY 엠파이어스테이트 제조업 지수

美 10월 산업생산

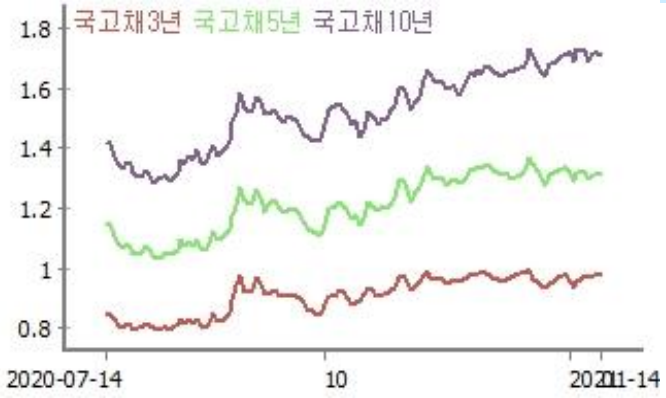
美 11월 기업재고

美 1월 미시건대 소비자 신뢰지수 (잠정치)

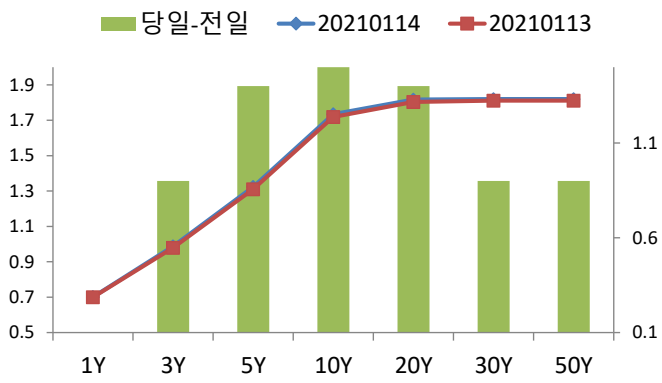
BONDWEB DAILY

# 본드웹 데일리

## 韓 국채 금리 추이

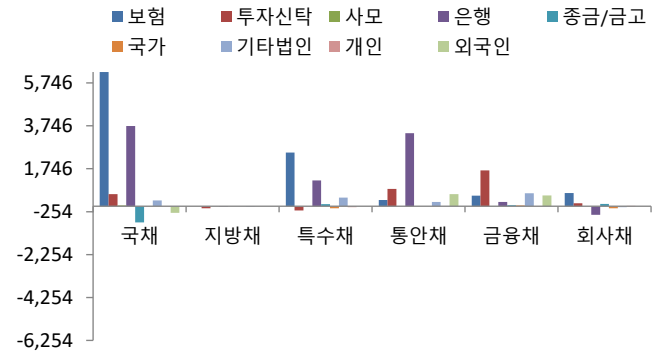



## 국고채별 금리등락 추이




## 국채선물 이론/실제/저평

## 장외채권 투자자별 매매동향

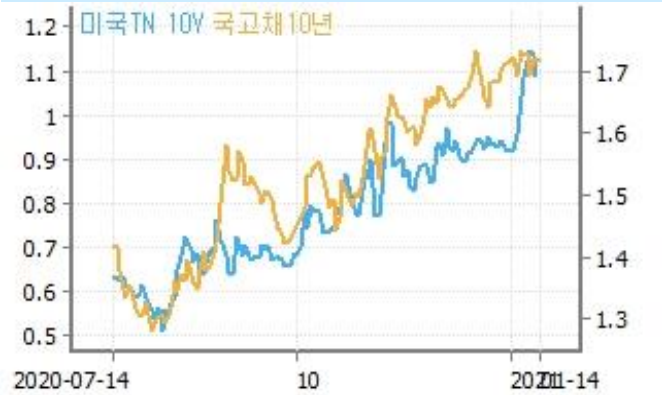



## 1Y IRS, CRS

## 韓 3년물 신용 스프레드

## USD/JPY, USD/KRW

## 美-韓 국채 10년물 금리 추이




KG ZEROIN

04517 서울시 중구 통일로92 케이지타워 17F, KG제로인