

IPS Daily Morning Brief

2020-01-29

종가 기준일 2020-01-28

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.4150	-1.75	1.4280	1.4405	1.4609	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.3975	-2.25	1.4145	1.4089	1.4308	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3875	-2.75	1.4070	1.3945	1.4107	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3700	-4.00	1.4000	1.3725	1.3862	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3475	-5.25	1.3920	1.3506	1.3619	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3300	-7.50	1.3950	1.3483	1.3593	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3375	-8.25	1.4085	1.3573	1.3639	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3375	-8.75	1.4135	1.3591	1.3653	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3375	-9.50	1.4195	1.3636	1.3668	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3625	-9.75	1.4480	1.3959	1.3963	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3750	-9.75	1.4615	1.4104	1.4069	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3575	-9.75	1.4440	1.3920	1.3913	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2800	-9.75	1.3685	1.3009	1.2912	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-1.75	-0.50	-1.35	-3.16	-3.02	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-1.00	-0.50	-0.75	-1.44	-2.01	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-4.00	-2.50	-1.50	-4.39	-4.88	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-1.75	-2.25	0.30	-0.24	-0.26	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-1.00	-3.00	1.65	0.66	0.20	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-1.00	-3.50	2.15	0.85	0.34	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	0.75	-0.75	1.35	0.90	0.45	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	0.75	-1.25	1.85	1.09	0.60	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.00	-0.50	0.50	0.19	0.14	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.00	-0.75	0.60	0.45	0.15	4.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	2.50	-1.00	3.45	3.68	3.10	12.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	2.50	-0.25	2.85	3.23	2.95	7.50	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.25	0.00	1.35	1.45	1.06	4.00	-1.00	6.00	-1.00
10*15Y	-0.50	0.00	-0.40	-0.39	-0.50	5.25	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-8.25	0.00	-7.95	-9.50	-10.51	6.25	-16.00	13.00	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.312	-2.70	1.339	1.338	1.380	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.356	-3.30	1.387	1.365	1.414	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.350	-6.00	1.404	1.378	1.422	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.347	-7.70	1.412	1.329	1.373	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.426	-7.30	1.489	1.472	1.516	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.455	-8.50	1.528	1.492	1.526	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.548	-9.10	1.633	1.615	1.635	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.601	-9.90	1.696	1.675	1.694	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.630	-9.70	1.714	1.688	1.660	2.430	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.46	0.00
CALL	1.26	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.59	0.28	110.64	110.67	110.55
LKTb	131.19	1.16	131.30	131.45	131.10

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	7.55	-0.05	6.78	5.63	3.06	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	1.40	-0.70	1.28	0.80	-2.74	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-0.25	0.75	-1.22	-2.75	-6.04	0.25	-12.95	0.25	-25.15
3Y	-1.70	0.20	-1.66	1.97	-1.40	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-8.85	-0.95	-8.05	-11.47	-15.17	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-11.75	-0.25	-11.47	-13.29	-16.07	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-21.05	-0.40	-21.31	-25.18	-26.78	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-23.85	0.15	-24.78	-27.89	-29.80	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-35.00	-0.05	-34.53	-38.72	-36.89	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1176.70 (+7.95)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-59.25	2.75	1Y	0.7950	0.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-4.00	0.00		
-59.50	4.00	1.5Y	0.7750	0.00	1.3950	1.1750	2*3Y	2.00	0.00		
-59.25	5.25	2Y	0.7550	0.00	1.3750	1.1600	2*5Y	2.50	0.00		
-55.50	7.50	3Y	0.7750	0.00	1.3800	0.0450	3*4Y	0.50	0.00		
-55.75	8.25	4Y	0.7800	0.00	1.4000	0.0350	3*5Y	0.50	0.00		
-55.75	8.75	5Y	0.7800	0.00	1.4550	0.0150	4*5Y	0.00	0.00		
-51.75	9.50	7Y	0.8200	0.00	1.5350	0.0750	5*7Y	4.00	0.00		
-49.25	9.75	10Y	0.8700	0.00	1.7800	0.2550	5*10Y	9.00	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	1.4742	0.0354	1.4388	1.5303	1.5263	2.9773	1.3841	2.9773	0.5600
10Y	1.6590	0.0491	1.6099	1.7736	1.7710	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	12.42	9.54	2.88	11.03	12.93	103.03	2.88	103.03	-102.70
10Y	5.80	14.81	-9.01	4.36	7.90	98.82	-9.01	98.82	-24.46

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	1.50	-4.50	6.00	7.00	6.50	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTb 2*10Y	25.10	-3.90	29.00	31.00	29.50	42.80	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	18.48	1.37	17.11	24.33	24.47	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6y 31						
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	34	SPRD	2*10y 1.25						
03Y			9m*2y -5						
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	5y CCS 68 / 70								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	115 건	-51	166	113	132	140	124	127	
금 액	37,438 억원	-73,877	111,315	42,275	45,562	44,490	40,455	58,682	

장중동향

국고채 금리, 신종 코로나 위험에 금리 급락. 안전자산 선호 심리 커져.

IRS, 신종 코로나바이러스 확산 우려를 한 번에 반영하며 금리 급락. 커브 플랫트닝.

CRS, 전 구간 금리 하락.