IPS Daily Morning Brief

2020-02-03

종가 기준일 2020-01-31

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3650	-0.75	1.4010	1.4283	1.4583	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.3425	-0.50	1.3815	1.3989	1.4276	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3275	-0.25	1.3695	1.3856	1.4076	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3150	-0.50	1.3600	1.3680	1.3836	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2975	-0.50	1.3445	1.3494	1.3597	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2850	-0.25	1.3380	1.3471	1.3570	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2850	-0.25	1.3445	1.3551	1.3617	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2825	-0.25	1.3450	1.3565	1.3630	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2800	0.00	1.3465	1.3598	1.3644	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3025	0.25	1.3715	1.3896	1.3937	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3150	0.25	1.3815	1.4028	1.4040	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.2975	0.50	1.3645	1.3845	1.3876	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2150	0.50	1.2845	1.2951	1.2870	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125
6*9M	-2.25	0.25	-1.95	-2.94	-3.07	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-1.50	0.25	-1.20	-1.33	-2.00	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-3.00	-0.25	-2.50	-3.63	-4.79	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-1.25	0.25	-0.65	-0.23	-0.27	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-1.25	0.25	0.00	0.58	0.20	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-1.50	0.25	0.05	0.71	0.33	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	0.00	0.00	0.65	0.80	0.47	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	-0.25	0.00	0.70	0.94	0.59	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	-0.25	0.00	0.05	0.14	0.13	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	-0.25	0.25	0.15	0.33	0.15	4.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	2.00	0.50	2.65	3.31	3.07	12.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	2.25	0.25	2.50	2.99	2.93	7.50	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.25	0.00	1.00	1.31	1.03	4.00	-1.00	6.00	-1.00
10*15Y	-0.50	0.25	-0.70	-0.51	-0.61	5.25	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-8.75	0.25	-8.70	-9.45	-10.66	6.25	-16.00	13.00	-16.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.264	-1.20	1.303	1.326	1.374	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.298	-1.60	1.345	1.358	1.407	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.300	-0.50	1.351	1.374	1.415	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.312	1.00	1.357	1.375	1.365	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.380	0.50	1.430	1.463	1.506	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.395	0.50	1.457	1.485	1.516	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.500	0.50	1.559	1.604	1.625	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.562	0.50	1.619	1.663	1.686	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.600	1.30	1.650	1.678	1.655	2.430	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.42	-1.00
CALL	1.25	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.76	0.69	110.72	110.79	110.69
LKTB	131.63	-0.06	131.59	131.80	131.42

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	6.35	0.95	6.63	5.95	3.36	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	1.70	1.10	1.46	0.96	-2.33	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-0.25	0.00	-0.69	-2.43	-5.57	0.25	-12.95	0.25	-25.15
3Y	-2.70	-1.25	-1.88	-2.83	-0.82	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-9.50	-0.75	-8.59	-10.79	-14.40	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-11.25	-0.75	-11.24	-12.89	-15.33	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-22.00	-0.50	-21.21	-24.42	-26.06	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-25.95	-0.25	-24.73	-27.35	-29.21	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-38.50	-0.80	-36.55	-38.26	-36.77	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-55.25	1.75
-58.50	1.50
-61.75	0.50
-61.00	-1.25
-61.00	-1.75
-60.75	-1.75
-56.50	-2.00
-53.75	-2.25

CRS

USD/KRW 1191.80 (+8.67)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.7750	1.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-9.50	-1.50
1.5Y	0.7300	1.00	1.3950	1.1750	2*3Y	-0.50	-1.50
2Y	0.6800	0.00	1.3750	1.1600	2*5Y	-0.50	-2.00
3Y	0.6750	-1.50	1.3800	0.0450	3*4Y	0.00	-0.50
4Y	0.6750	-2.00	1.4000	0.0350	3*5Y	0.00	-0.50
5Y	0.6750	-2.00	1.4550	0.0150	4*5Y	0.00	0.00
7Y	0.7150	-2.00	1.5350	0.0750	5*7Y	4.00	0.00
10Y	0.7650	-2.00	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	1.3231	-0.0996	1.4227	1.4227	1.5178	2.9773	1.3231	2.9773	0.5600
10Y	1.5086	-0.0797	1.5883	1.5841	1.7336	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	2.31	-9.46	11.77	9.07	10.78	103.03	2.31	103.03	-99.00
10Y	-5.34	-8.47	3.13	0.91	3.36	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	0.50	0.75	-0.25	1.25	6.00	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTB 2*10Y	26.20	1.00	25.20	24.30	29.00	42.80	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	18.55	1.99	16.56	16.14	21.58	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	36.5	ODD Tenor	
09M	34.5 / 35		
01Y	33		
1.5Y			
02Y	30.25	SPRD	1*1.5y -1.5
03Y	28.75		1*2y -3
04Y			
05Y	28.75		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1.5y CCS 73 2*3y CCS 00		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	114 건	-25	139	179	115	166	113	132
금 액	61,935 억원	-7,605	69,540	76,334	37,438	111,315	42,275	45,562

장중동향

국고채 금리, 신종 코로나 여파 속 금리 상승.

IRS, 5Y 이하 금리 하락 하며 혼조 마감. 커브 스티프닝.

CRS, 대부분 구간에서 금리 상승.