IPS Daily Morning Brief

2020-02-05

종가 기준일 2020-02-04

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3800	2.00	1.3760	1.4199	1.4544	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.3575	2.25	1.3520	1.3934	1.4237	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3400	2.25	1.3350	1.3815	1.4039	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3275	3.00	1.3210	1.3669	1.3800	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3100	3.50	1.3015	1.3505	1.3561	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3025	4.25	1.2885	1.3485	1.3532	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3125	5.00	1.2915	1.3565	1.3580	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3200	6.00	1.2910	1.3579	1.3590	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3225	6.50	1.2890	1.3604	1.3604	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3525	6.75	1.3150	1.3894	1.3896	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3650	6.75	1.3260	1.4025	1.3998	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3475	6.75	1.3080	1.3838	1.3830	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2675	6.75	1.2270	1.2958	1.2825	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125
6*9M	-2.25	0.25	-2.40	-2.65	-3.07	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-1.75	0.00	-1.70	-1.19	-1.98	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-3.00	1.25	-3.35	-3.10	-4.78	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-0.75	0.75	-1.30	-0.20	-0.30	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	0.25	1.50	-1.00	0.60	0.18	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	1.00	2.50	-1.05	0.74	0.29	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.00	0.75	0.30	0.80	0.48	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	1.75	1.75	0.25	0.94	0.59	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.75	1.00	-0.05	0.14	0.11	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.25	0.50	-0.20	0.25	0.13	4.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	3.25	0.75	2.40	3.15	3.06	12.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.00	0.25	2.60	2.90	2.93	7.50	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.25	0.00	1.10	1.31	1.01	4.00	-1.00	6.00	-1.00
10*15Y	-0.50	0.00	-0.70	-0.56	-0.67	5.25	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-8.50	0.00	-8.80	-9.36	-10.71	6.25	-16.00	13.00	-16.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.266	1.30	1.271	1.319	1.369	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.302	2.10	1.306	1.355	1.401	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.312	3.20	1.306	1.372	1.409	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.334	4.40	1.312	1.377	1.358	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.412	5.20	1.385	1.462	1.497	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.442	6.60	1.405	1.487	1.508	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.555	6.80	1.511	1.603	1.617	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.632	7.70	1.576	1.663	1.678	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.657	6.70	1.609	1.676	1.649	2.430	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.42	0.00
CALL	1.21	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.66	-0.16	110.78	110.79	110.66
LKTB	130.89	-0.82	131.55	131.58	130.89

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	7.40	0.95	6.36	6.23	3.49	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	2.55	0.90	1.46	1.18	-2.07	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-0.20	0.30	-0.43	-2.18	-5.25	0.25	-12.95	0.25	-25.15
3Y	-3.15	-0.15	-2.35	-2.85	-0.46	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-9.95	-0.20	-9.37	-10.54	-13.89	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-12.20	-0.60	-11.40	-12.89	-14.85	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-23.25	-0.30	-22.24	-24.23	-25.63	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-27.95	-0.95	-26.12	-27.38	-28.84	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-38.95	0.05	-38.16	-38.06	-36.67	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-61.00	-1.25
-65.75	-2.00
-69.50	-1.50
-70.25	-2.25
-71.25	-3.00
-72.00	-4.00
-68.25	-4.50
-67.25	-5.75

CRS

USD/KRW 1187.40 (-7.60)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.7300	1.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-11.50	1.00
1.5Y	0.6700	1.00	1.3950	1.1750	2*3Y	-1.50	0.00
2Y	0.6150	2.00	1.3750	1.1600	2*5Y	-1.50	0.00
3Y	0.6000	2.00	1.3800	0.0450	3*4Y	0.00	0.00
4Y	0.6000	2.00	1.4000	0.0350	3*5Y	0.00	0.00
5Y	0.6000	2.00	1.4550	0.0150	4*5Y	0.00	0.00
7Y	0.6400	2.00	1.5350	0.0750	5*7Y	4.00	0.00
10Y	0.6800	1.00	1.7800	0.2550	5*10Y	8.00	-1.00

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	1.4150	0.0640	1.3510	1.3231	1.4227	2.9773	1.3231	2.9773	0.5600
10Y	1.6018	0.0702	1.5316	1.5086	1.5883	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	10.30	3.2	7.10	2.31	11.77	103.03	2.31	103.03	-92.00
10Y	-3.02	-0.68	-2.34	-5.34	3.13	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	4.25	3.25	1.00	0.50	-0.25	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTB 2*10Y	32.00	4.50	27.50	26.20	25.20	42.80	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	18.68	0.62	18.06	18.55	16.56	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	31 / 32.25		
02Y	28.5	SPRD	6m*1.5Y -5.25
03Y			1*1.5Y -1.5
04Y			1*2Y -3.75 / -3.5
05Y	31 / 31.25 / 331.5		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y CCS 72		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	114 건	44	70	114	139	179	115	166
금 액	36,000 억원	4,771	31,229	61,935	69,540	76,334	37,438	111,315

장중동향

국고채 금리, 리스크온 분위기에 금리 상승.
국고 30년 입찰 부담이 작용하는 가운데 RBA 동결과 주식시장 강세 등 영향.

IRS, 전 구간 금리 상승. 커브 스티프닝.

CRS, 금리 상승 마감.