IPS Daily Morning Brief

2020-02-06

종가 기준일 2020-02-05

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3725	-0.75	1.3700	1.4168	1.4519	1.9125	1.3575	1.9125	1.2875
9M	1.3500	-0.75	1.3465	1.3919	1.4211	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3325	-0.75	1.3295	1.3810	1.4013	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3150	-1.25	1.3150	1.3678	1.3775	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2950	-1.50	1.2960	1.3523	1.3535	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2875	-1.50	1.2845	1.3508	1.3503	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2975	-1.50	1.2890	1.3593	1.3553	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3025	-1.75	1.2900	1.3610	1.3563	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3050	-1.75	1.2890	1.3635	1.3576	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3350	-1.75	1.3150	1.3925	1.3868	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3475	-1.75	1.3275	1.4054	1.3968	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3300	-1.75	1.3095	1.3868	1.3798	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2500	-1.75	1.2285	1.2996	1.2798	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125
6*9M	-2.25	0.00	-2.35	-2.49	-3.08	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-1.75	0.00	-1.70	-1.09	-1.98	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-3.75	-0.75	-3.35	-2.88	-4.78	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-0.75	0.00	-1.15	-0.15	-0.31	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	0.25	0.00	-0.70	0.70	0.18	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	0.75	-0.25	-0.60	0.88	0.29	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.00	0.00	0.45	0.85	0.49	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	1.50	-0.25	0.55	1.03	0.60	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.50	-0.25	0.10	0.18	0.11	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.25	0.00	-0.10	0.25	0.13	4.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	3.25	0.00	2.50	3.15	3.05	12.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.00	0.00	2.60	2.90	2.92	7.50	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.25	0.00	1.25	1.29	1.00	4.00	-1.00	6.00	-1.00
10*15Y	-0.50	0.00	-0.55	-0.57	-0.70	5.25	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-8.50	0.00	-8.65	-9.29	-10.70	6.25	-16.00	13.00	-16.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.258	-0.80	1.263	1.317	1.366	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.295	-0.70	1.298	1.354	1.398	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.285	-2.70	1.296	1.372	1.405	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.312	-2.20	1.310	1.379	1.354	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.387	-2.50	1.383	1.463	1.492	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.415	-2.70	1.404	1.490	1.503	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.529	-2.60	1.513	1.604	1.613	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.602	-3.00	1.582	1.665	1.674	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.627	-3.00	1.612	1.679	1.647	2.430	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.42	0.00
CALL	1.23	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.74	0.08	110.61	110.78	110.59
LKTB	131.20	0.31	130.74	131.38	130.67

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	7.45	0.05	6.61	6.42	3.49	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	2.00	-0.55	1.70	1.35	-2.02	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	1.00	1.20	-0.04	-1.93	-5.13	1.00	-12.95	1.00	-25.15
3Y	-2.45	0.70	-2.55	-2.79	-0.34	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-8.95	1.00	-9.38	-10.34	-13.72	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-11.25	0.95	-11.36	-12.85	-14.69	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-22.40	0.85	-22.42	-24.07	-25.50	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-26.70	1.25	-26.66	-27.30	-28.74	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-37.70	1.25	-38.37	-37.90	-36.68	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-59.25	1.75
-63.00	2.75
-66.50	3.00
-67.75	2.50
-68.75	2.50
-68.75	3.25
-65.00	3.25
-64.00	3.25

CRS

USD/KRW 1191.50 (+4.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.7400	1.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-11.00	0.50
1.5Y	0.6850	1.50	1.3950	1.1750	2*3Y	-2.00	-0.50
2Y	0.6300	1.50	1.3750	1.1600	2*5Y	-1.50	0.00
3Y	0.6100	1.00	1.3800	0.0450	3*4Y	0.00	0.00
4Y	0.6100	1.00	1.4000	0.0350	3*5Y	0.50	0.50
5Y	0.6150	1.50	1.4550	0.0150	4*5Y	0.50	0.50
7Y	0.6550	1.50	1.5350	0.0750	5*7Y	4.00	0.00
10Y	0.6950	1.50	1.7800	0.2550	5*10Y	8.00	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	1.4471	0.0321	1.4150	1.3510	1.3231	2.9773	1.3231	2.9773	0.5600
10Y	1.6536	0.0518	1.6018	1.5316	1.5086	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	16.21	5.91	10.30	7.10	2.31	103.03	2.31	103.03	-91.70
10Y	5.16	8.18	-3.02	-2.34	-5.34	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	4.00	-0.25	4.25	1.00	0.50	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTB 2*10Y	31.70	-0.30	32.00	27.50	26.20	42.80	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	20.65	1.97	18.68	18.06	18.55	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	33		
1.5Y			
02Y	29.25	SPRD	1*2Y -3.5
03Y	28.5		1.5*2Y -02
04Y			8*15Y 1.75
05Y			
07Y	29.5		
10Y	33.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3*7y CCS 4.5 1y CCS 73.5		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	95 건	-19	114	70	114	139	179	115
금 액	31,244 억원	-4,756	36,000	31,229	61,935	69,540	76,334	37,438

장중동향

국고채 금리, 롤러코스터 장세 속 금리 하락.

IRS, 전 구간 금리 하락.
2년 구간을 중심으로 비디시한 모습.

CRS, 전 구간 금리 상승.