

IPS Daily Morning Brief

2020-02-10

종가 기준일 2020-02-07

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3450	-2.00	1.3645	1.4091	1.4473	1.9125	1.3450	1.9125	1.2875
9M	1.3150	-2.75	1.3400	1.3858	1.4165	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.2975	-2.75	1.3225	1.3765	1.3967	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2775	-3.50	1.3060	1.3640	1.3731	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2600	-3.25	1.2865	1.3486	1.3490	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2625	-2.75	1.2805	1.3479	1.3455	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2700	-3.25	1.2890	1.3570	1.3506	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2750	-3.75	1.2940	1.3598	1.3517	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2875	-3.25	1.2985	1.3630	1.3532	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3250	-2.75	1.3300	1.3919	1.3825	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3375	-2.75	1.3425	1.4043	1.3924	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3225	-2.75	1.3260	1.3861	1.3751	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2450	-2.25	1.2460	1.3006	1.2757	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-3.00	-0.75	-2.45	-2.34	-3.08	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-1.75	0.00	-1.75	-0.92	-1.98	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-3.75	-0.50	-3.60	-2.79	-4.76	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.25	0.50	-0.60	-0.07	-0.35	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	1.00	0.00	0.25	0.84	0.15	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	1.50	-0.50	0.75	1.11	0.26	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	0.75	-0.50	0.85	0.91	0.51	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	1.25	-1.00	1.35	1.19	0.62	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.50	-0.50	0.50	0.27	0.11	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	1.25	0.50	0.45	0.33	0.15	4.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	5.00	1.00	3.60	3.21	3.08	12.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.75	0.50	3.15	2.89	2.93	7.50	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.25	0.00	1.25	1.24	0.99	4.00	-1.00	6.00	-1.00
10*15Y	-0.25	0.00	-0.40	-0.57	-0.74	5.25	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-8.00	0.50	-8.40	-9.13	-10.68	6.00	-16.00	13.00	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.247	-1.00	1.256	1.311	1.361	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.259	-2.90	1.285	1.348	1.391	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.247	-2.80	1.280	1.362	1.397	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.277	-2.50	1.303	1.373	1.346	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.359	-2.30	1.380	1.455	1.484	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.400	-1.50	1.410	1.485	1.496	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.521	-1.50	1.526	1.599	1.606	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.602	-1.30	1.601	1.663	1.668	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.627	-0.80	1.627	1.677	1.642	2.430	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.42	0.00
CALL	1.22	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.82	0.08	110.77	110.89	110.74
LKTB	131.20	0.23	131.10	131.38	131.00

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	5.05	-1.75	6.63	6.58	3.57	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	1.85	-0.60	2.10	1.57	-1.78	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	1.30	-0.45	0.67	-1.34	-4.78	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-1.45	-0.25	-2.25	-2.46	-0.09	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-8.90	-0.95	-9.10	-9.81	-13.37	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-12.50	-2.25	-11.56	-12.53	-14.40	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-23.35	-1.75	-22.71	-23.59	-25.23	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-27.70	-1.45	-27.12	-27.11	-28.54	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-38.20	-1.45	-38.12	-37.63	-36.61	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW	11886.50	#####
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-54.75	0.25	1Y	0.7500	-2.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-12.50	-1.00	
-58.75	0.50	1.5Y	0.6900	-3.00	1.3950	1.1750	2*3Y	-3.50	-1.50	
-63.50	-0.25	2Y	0.6250	-3.50	1.3750	1.1600	2*5Y	-6.00	-2.50	
-67.25	-2.25	3Y	0.5900	-5.00	1.3800	0.0450	3*4Y	-1.50	-0.50	
-69.50	-2.25	4Y	0.5750	-5.50	1.4000	0.0350	3*5Y	-2.50	-1.00	
-71.00	-2.25	5Y	0.5650	-6.00	1.4550	0.0150	4*5Y	-1.00	-0.50	
-68.25	-2.75	7Y	0.6050	-6.00	1.5350	0.0750	5*7Y	4.00	0.00	
-68.00	-3.25	10Y	0.6450	-6.00	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	1.4031	-0.0562	1.4593	1.4471	1.4150	2.9773	1.3231	2.9773	0.5600
10Y	1.5836	-0.0596	1.6432	1.6536	1.6018	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	15.61	-2.82	18.43	16.21	10.30	103.03	2.31	103.03	-89.20
10Y	-1.84	-4.66	2.82	5.16	-3.02	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	6.50	0.50	6.00	4.00	4.25	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTb 2*10Y	35.50	1.50	34.00	31.70	32.00	42.80	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	18.05	-0.34	18.39	20.65	18.68	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6Y 29						
06M									
09M									
01Y	29.25 / 29.5								
1.5Y	28								
02Y		SPRD	1*2Y -3.5						
03Y			1.5*5Y 00						
04Y	29								
05Y	26.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y CCS 75								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	140 건	44	96	95	114	70	114	139	
금 액	64,380 억원	28,167	36,213	31,244	36,000	31,229	61,935	69,540	

장중동향
국고채 금리, 신종 코로나에 금리 하락. 커브 스티프닝.

IRS, 전 구간 금리 하락.
금리 인하 기대 강화에 2년 이하 구간 중심으로 오퍼리시.

CRS, 금리 하락 마감.