

IPS Daily Morning Brief

2020-02-12

종가 기준일 2020-02-11

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3425	-0.50	1.3545	1.3990	1.4424	1.9125	1.3425	1.9125	1.2875
9M	1.3150	-0.50	1.3285	1.3795	1.4117	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.2900	-0.50	1.3080	1.3650	1.3917	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2700	-0.75	1.2905	1.3523	1.3682	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2525	-1.00	1.2725	1.3373	1.3441	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2500	-1.25	1.2705	1.3361	1.3403	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2550	-1.00	1.2780	1.3449	1.3452	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2575	-1.25	1.2835	1.3479	1.3460	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2650	-1.00	1.2905	1.3516	1.3476	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3050	-0.75	1.3260	1.3814	1.3772	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3200	-0.50	1.3390	1.3939	1.3870	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3050	-0.50	1.3235	1.3764	1.3694	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2275	-0.50	1.2445	1.2936	1.2710	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-2.75	0.00	-2.60	-1.95	-3.07	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-2.50	0.00	-2.05	-1.45	-2.00	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-3.75	-0.50	-3.55	-2.78	-4.76	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-0.25	-0.25	-0.20	-0.11	-0.38	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	0.25	0.00	0.55	0.76	0.11	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	0.50	-0.25	1.10	1.06	0.19	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	0.50	0.25	0.75	0.87	0.49	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	0.75	0.00	1.30	1.18	0.57	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.25	-0.25	0.55	0.30	0.08	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.75	0.25	0.70	0.38	0.16	4.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	4.75	0.50	4.25	3.35	3.12	12.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.00	0.25	3.55	2.98	2.96	7.50	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.50	0.25	1.30	1.25	0.98	4.00	-1.00	5.75	-1.00
10*15Y	0.00	0.25	-0.25	-0.50	-0.77	5.25	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-7.75	0.25	-8.15	-8.78	-10.62	6.00	-16.00	12.75	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.245	-0.20	1.251	1.302	1.355	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.259	-0.40	1.273	1.338	1.383	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.255	-0.50	1.264	1.347	1.388	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.292	-0.30	1.296	1.360	1.339	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.365	-0.60	1.373	1.439	1.476	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.405	-0.50	1.409	1.472	1.488	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.520	-0.60	1.526	1.585	1.598	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.597	-0.80	1.604	1.653	1.661	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.605	-1.20	1.622	1.670	1.636	2.430	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.42	0.00
CALL	1.25	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.78	0.01	110.78	110.84	110.70
LKTb	131.30	0.07	131.30	131.50	131.03

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	4.50	-0.30	5.72	6.32	3.72	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	1.10	-0.35	1.77	1.43	-1.46	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-0.25	-0.50	0.81	-0.97	-4.42	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-4.20	-0.95	-2.51	-2.41	0.17	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-11.00	-0.40	-9.48	-9.46	-13.03	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-14.75	-0.75	-12.55	-12.39	-14.19	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-25.50	-0.40	-23.59	-23.32	-25.05	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-29.20	0.05	-27.82	-27.20	-28.37	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-37.75	0.70	-37.77	-37.59	-36.54	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1181.60 (-5.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-53.00	0.00	1Y	0.7600	-0.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-13.00	0.50		
-57.00	0.25	1.5Y	0.7000	-0.50	1.3950	1.1500	2*3Y	-3.00	0.00		
-62.25	1.00	2Y	0.6300	0.00	1.3750	1.1500	2*5Y	-5.00	0.00		
-65.00	1.25	3Y	0.6000	0.00	1.3800	0.0450	3*4Y	-1.50	0.00		
-67.00	1.00	4Y	0.5850	0.00	1.4000	0.0350	3*5Y	-2.00	0.00		
-67.75	1.25	5Y	0.5800	0.00	1.4550	0.0150	4*5Y	-0.50	0.00		
-64.50	1.00	7Y	0.6200	0.00	1.5350	0.0750	5*7Y	4.00	0.00		
-64.50	0.75	10Y	0.6600	0.00	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	1.4315	0.0283	1.4032	1.4031	1.4593	2.9773	1.3231	2.9773	0.5600
10Y	1.6059	0.0318	1.5741	1.5836	1.6432	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	17.65	3.33	14.32	15.61	18.43	103.03	2.31	103.03	-87.50
10Y	0.89	3.98	-3.09	-1.84	2.82	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	5.25	0.25	5.00	6.50	6.00	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTb 2*10Y	34.20	-0.30	34.50	35.50	34.00	42.80	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	17.44	0.35	17.09	18.05	18.39	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	26.75 / 26.5 / 27								
02Y	26 / 25.75 / 24.5 / 24.75 / 25	SPRD	3*6y 1.25						
03Y	26								
04Y									
05Y	25.5								
07Y									
10Y	30 / 31								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1.5y CCS 68								
	2y CCS 63								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	126 건	65	61	140	96	95	114	70	
금 액	60,374 억원	35,464	24,910	64,380	36,213	31,244	36,000	31,229	

장중동향
국고채 금리. 이벤트 부채 속 외인 매매 패턴 등에 따라 금리 혼조.

IRS. 전 구간에서 금리 하락.

CRS. 전 구간 금리 하락 마감.