

IPS Daily Morning Brief

2020-02-13

종가 기준일 2020-02-13

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3450	-0.25	1.3455	1.3916	1.4380	1.9125	1.3425	1.9125	1.2875
9M	1.3150	-0.50	1.3170	1.3703	1.4075	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.2875	-0.50	1.2925	1.3539	1.3873	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2700	-0.50	1.2740	1.3408	1.3640	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2475	-0.75	1.2555	1.3251	1.3398	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2475	-0.75	1.2555	1.3234	1.3358	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2575	-0.75	1.2625	1.3316	1.3409	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2600	-1.00	1.2665	1.3348	1.3416	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2700	-0.75	1.2750	1.3389	1.3434	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3100	-0.75	1.3140	1.3693	1.3734	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3250	-0.75	1.3280	1.3818	1.3834	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3075	-1.00	1.3125	1.3646	1.3655	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2225	-1.75	1.2335	1.2833	1.2680	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-3.00	-0.25	-2.85	-2.14	-3.06	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-2.75	0.00	-2.45	-1.64	-2.01	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-4.00	-0.25	-3.70	-2.88	-4.75	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.00	0.00	0.00	-0.17	-0.40	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	1.00	0.00	0.70	0.65	0.11	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	1.25	-0.25	1.10	0.96	0.18	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.00	0.00	0.70	0.82	0.51	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	1.25	-0.25	1.10	1.14	0.58	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.25	-0.25	0.40	0.31	0.07	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	1.00	0.25	0.85	0.41	0.17	4.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	5.00	0.25	4.75	3.45	3.18	12.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.00	0.00	3.90	3.04	3.00	7.50	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.50	0.00	1.40	1.25	1.00	4.00	-1.00	5.75	-1.00
10*15Y	-0.25	-0.25	-0.15	-0.46	-0.79	5.25	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-8.75	-1.00	-8.05	-8.60	-10.54	6.00	-16.00	12.75	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.238	-7.00	1.257	1.295	1.350	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.253	-8.20	1.274	1.330	1.377	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.242	-10.30	1.270	1.337	1.381	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.272	-2.00	1.286	1.349	1.331	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.354	-1.80	1.364	1.426	1.468	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.397	-2.30	1.406	1.460	1.481	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.521	-1.80	1.525	1.572	1.592	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.605	-1.00	1.605	1.642	1.655	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.622	0.90	1.617	1.659	1.632	2.430	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.42	0.00
CALL	1.26	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.83	0.08	110.81	110.84	110.74
LKTb	131.22	0.12	131.29	131.35	130.95

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	4.95	6.50	3.55	5.85	3.72	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	1.70	7.70	0.02	1.05	-1.29	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	0.55	9.55	-1.43	-1.20	-4.15	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-2.45	1.25	-3.01	-2.54	0.47	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-9.65	1.05	-10.17	-9.44	-12.66	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-13.70	1.30	-13.99	-12.52	-13.95	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-25.10	1.05	-25.04	-23.35	-24.84	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-29.50	0.25	-29.08	-27.28	-28.15	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-39.95	-2.65	-38.33	-37.59	-36.39	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1182.80 (+3.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-54.25	-0.50	1Y	0.7450	-1.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-9.50	2.00		
-57.00	0.50	1.5Y	0.7000	0.00	1.3950	1.1050	2*3Y	-4.00	0.00		
-59.75	1.75	2Y	0.6500	1.00	1.3750	1.1000	2*5Y	-6.00	0.50		
-63.75	1.75	3Y	0.6100	1.00	1.3800	0.0450	3*4Y	-1.00	0.50		
-65.75	2.25	4Y	0.6000	1.50	1.4000	0.0350	3*5Y	-2.00	0.50		
-67.00	2.50	5Y	0.5900	1.50	1.4550	0.0150	4*5Y	-1.00	0.00		
-64.50	1.75	7Y	0.6250	1.00	1.5350	0.0750	5*7Y	3.50	-0.50		
-66.00	1.25	10Y	0.6500	0.50	1.7800	0.2550	5*10Y	6.00	-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	1.4438	0.0001	1.4437	1.4315	1.4032	2.9773	1.3231	2.9773	0.5600
10Y	1.6206	-0.0163	1.6369	1.6059	1.5741	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	20.18	10.31	9.87	17.65	14.32	103.03	2.31	103.03	-87.50
10Y	1.56	-0.63	2.19	0.89	-3.09	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	6.25	0.00	6.25	5.25	5.00	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTb 2*10Y	36.30	9.30	27.00	34.20	34.50	42.80	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	17.68	-1.64	19.32	17.44	17.09	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y									
03Y		SPRD							
04Y	25.5								
05Y									
07Y									
10Y	30.75								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	76 건	-19	95	126	61	140	96	95	
금 액	26,100 억원	-9,763	35,863	60,374	24,910	64,380	36,213	31,244	

장중동향
국고채 금리. 단기물 중심으로 기준금리 인하 기대감 작용으로 인한 하락. 20년 이상 구간에서는 상승.

IRS. 전 구간 소폭 하락.

CRS. 1년 제외 전 구간 상승 마감.