

IPS Daily Morning Brief

2020-02-17

종가 기준일 2020-02-14

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3800	3.50	1.3525	1.3893	1.4364	1.9125	1.3425	1.9125	1.2875
9M	1.3550	4.00	1.3250	1.3671	1.4060	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3350	4.75	1.3000	1.3505	1.3859	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3200	5.00	1.2825	1.3376	1.3628	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.3025	5.50	1.2640	1.3220	1.3387	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.3050	5.75	1.2640	1.3203	1.3348	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.3075	5.00	1.2700	1.3281	1.3398	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.3100	5.00	1.2735	1.3313	1.3405	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.3175	4.75	1.2810	1.3356	1.3424	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3575	4.75	1.3205	1.3666	1.3727	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3700	4.50	1.3345	1.3790	1.3828	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3550	4.75	1.3190	1.3621	1.3648	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2700	4.75	1.2385	1.2809	1.2678	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-2.50	0.50	-2.75	-2.21	-3.05	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-2.00	0.75	-2.50	-1.66	-2.01	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-3.25	0.75	-3.60	-2.85	-4.72	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.25	0.25	0.00	-0.17	-0.39	6.50	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	0.50	-0.50	0.60	0.61	0.11	11.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	0.75	-0.50	0.95	0.93	0.18	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	0.25	-0.75	0.60	0.79	0.50	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	0.50	-0.75	0.95	1.10	0.58	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.25	0.00	0.35	0.31	0.07	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.75	-0.25	0.75	0.44	0.19	4.50	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	4.75	-0.25	4.70	3.54	3.22	11.75	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.00	0.00	3.95	3.10	3.03	7.25	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.25	-0.25	1.40	1.24	1.00	4.00	-1.00	5.75	-1.00
10*15Y	-0.25	0.00	-0.15	-0.45	-0.79	5.25	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-8.75	0.00	-8.20	-8.58	-10.50	6.00	-16.00	12.75	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.273	3.50	1.262	1.292	1.347	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.288	3.50	1.280	1.326	1.373	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.290	4.80	1.278	1.332	1.378	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.330	5.80	1.296	1.346	1.328	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.407	5.30	1.374	1.423	1.464	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.457	6.00	1.418	1.458	1.479	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.577	5.60	1.537	1.570	1.590	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.657	5.20	1.616	1.640	1.653	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.665	4.30	1.624	1.657	1.631	2.430	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.42	0.00
CALL	1.23	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.60	-0.23	110.83	110.88	110.53
LKTb	130.64	-0.58	131.22	131.29	130.45

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 반영평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	6.20	1.25	3.78	5.83	3.86	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	3.20	1.50	0.29	1.17	-1.07	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	1.25	0.70	-1.44	-0.98	-3.92	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-2.50	-0.05	-3.22	-2.55	0.68	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-9.95	-0.30	-10.38	-9.45	-12.46	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-14.70	-1.00	-14.43	-12.63	-13.83	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-25.95	-0.85	-25.56	-23.41	-24.73	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-29.95	-0.45	-29.53	-27.35	-28.01	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-39.50	0.45	-38.59	-37.60	-36.30	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1183.00 (+0.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-57.00	-2.75	1Y	0.7650	2.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-8.00	1.50		
-59.00	-2.00	1.5Y	0.7300	3.00	1.3950	1.1050	2*3Y	-5.00	-1.00		
-61.75	-2.00	2Y	0.6850	3.50	1.3750	1.1000	2*5Y	-8.00	-2.00		
-67.00	-3.25	3Y	0.6350	2.50	1.3800	0.0450	3*4Y	-1.50	-0.50		
-68.75	-3.00	4Y	0.6200	2.00	1.4000	0.0350	3*5Y	-3.00	-1.00		
-70.50	-3.50	5Y	0.6050	1.50	1.4550	0.0150	4*5Y	-1.50	-0.50		
-67.75	-3.25	7Y	0.6400	1.50	1.5350	0.0750	5*7Y	3.50	0.00		
-69.25	-3.25	10Y	0.6650	1.50	1.7800	0.2550	5*10Y	6.00	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	1.4238	-0.0200	1.4438	1.4437	1.4315	2.9773	1.3231	2.9773	0.5600
10Y	1.5883	-0.0323	1.6206	1.6369	1.6059	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	13.38	-6.8	20.18	9.87	17.65	103.03	2.31	103.03	-87.50
10Y	-6.87	-8.43	1.56	2.19	0.89	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	5.50	-0.75	6.25	6.25	5.25	26.25	-9.50	46.00	-9.50
KTb 2*10Y	36.70	0.40	36.30	27.00	34.20	42.80	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	16.45	-1.23	17.68	19.32	17.44	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M	34.5									
09M										
01Y	28.50 / 28.25 / 33.5									
1.5Y										
02Y	23.50 / 30				SPRD					
03Y										
04Y										
05Y	29 / 29.5									
07Y										
10Y	31.5									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			121 건	45	76	95	126	61	140	96
금 액			41,402 억원	15,302	26,100	35,863	60,374	24,910	64,380	36,213

장중동향
국고채 금리. 이주열 총재의 매파 발언으로 인한 금리 급반등.

IRS. 전 구간 큰 폭 상승.

CRS. 전 구간 상승 마감.