IPS Daily Morning Brief

2020-02-19

종가 기준일 2020-02-17

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3700	-1.00	1.3570	1.3860	1.4347	1.9125	1.3425	1.9125	1.2875
9M	1.3425	-1.25	1.3295	1.3631	1.4043	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.3225	-1.25	1.3055	1.3460	1.3843	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.3050	-1.50	1.2880	1.3325	1.3614	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2850	-1.75	1.2685	1.3164	1.3375	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2825	-2.25	1.2680	1.3144	1.3337	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2850	-2.25	1.2740	1.3220	1.3388	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2850	-2.50	1.2765	1.3251	1.3396	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2850	-3.25	1.2830	1.3295	1.3416	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.3200	-3.75	1.3220	1.3610	1.3722	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.3325	-3.75	1.3360	1.3733	1.3825	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.3175	-3.75	1.3205	1.3566	1.3644	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.2325	-3.75	1.2385	1.2755	1.2678	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-2.75	-0.25	-2.75	-2.29	-3.04	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-2.00	0.00	-2.40	-1.71	-2.00	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-3.75	-0.50	-3.70	-2.96	-4.68	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-0.25	-0.50	-0.05	-0.20	-0.38	6.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	0.00	-0.50	0.55	0.56	0.13	10.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	0.00	-0.75	0.80	0.88	0.21	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	0.25	0.00	0.60	0.76	0.51	4.75	-3.25	9.00	-3.25
3*5Y	0.25	-0.25	0.85	1.08	0.59	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	0.00	-0.25	0.25	0.31	0.08	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	0.00	-0.75	0.65	0.44	0.20	4.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	3.50	-1.25	4.55	3.59	3.25	11.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.50	-0.50	3.90	3.15	3.06	7.25	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.25	0.00	1.40	1.23	1.03	4.00	-1.00	5.75	-1.00
10*15Y	-0.25	0.00	-0.15	-0.44	-0.77	5.25	-3.25	9.25	-3.25
10*20Y	-8.75	0.00	-8.35	-8.55	-10.43	6.00	-16.00	12.00	-16.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.273	0.00	1.267	1.289	1.345	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.279	-0.90	1.283	1.320	1.370	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.277	-1.30	1.282	1.325	1.374	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.310	-2.00	1.299	1.340	1.325	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.381	-2.60	1.376	1.416	1.462	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.425	-3.20	1.421	1.452	1.477	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.534	-4.30	1.538	1.564	1.588	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.615	-4.20	1.618	1.636	1.651	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.635	-3.00	1.628	1.654	1.646	2.420	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	110.69	0.09	110.56	110.69	110.52
LKTB	131.15	0.51	130.50	131.15	130.47

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	4.95	-1.25	3.81	5.74	3.97	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	2.60	-0.60	0.52	1.21	-0.88	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	0.80	-0.45	-1.33	-0.85	-3.69	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-2.75	-0.25	-3.12	-2.56	0.86	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-9.60	0.35	-10.18	-9.44	-12.27	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-14.00	0.70	-14.43	-12.69	-13.71	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-24.90	1.05	-25.52	-23.48	-24.60	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-29.50	0.45	-29.58	-27.46	-27.88	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-40.25	-0.75	-38.95	-37.89	-37.84	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-64.50	-7.50
-64.50	-5.50
-64.75	-3.00
-67.00	0.00
-68.00	0.75
-68.75	1.75
-66.75	1.00
-68.75	0.50

CRS

USD/KRW 1183.90 (+0.90)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.6775	-8.75	1.4550	0.3900	1*2Y	-4.00	4.00
1.5Y	0.6600	-7.00	1.3950	1.1050	2*3Y	-2.50	2.50
2Y	0.6375	-4.75	1.3750	1.1000	2*5Y	-4.00	4.00
3Y	0.6125	-2.25	1.3800	0.0450	3*4Y	-0.75	0.75
4Y	0.6050	-1.50	1.4000	0.0350	3*5Y	-1.50	1.50
5Y	0.5975	-0.75	1.4550	0.0150	4*5Y	-0.75	0.75
7Y	0.6175	-2.25	1.5350	0.0750	5*7Y	2.00	-1.50
10Y	0.6325	-3.25	1.7800	0.2550	5*10Y	3.50	-2.50

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	0.0000	1.4238	1.4438	1.4437	2.9773	1.3231	2.9773	0.5600
10Y	1.5883	0.0000	1.5883	1.6206	1.6369	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	14.68	1.3	13.38	20.18	9.87	103.03	2.31	103.03	-87.50
10Y	-2.67	4.20	-6.87	1.56	2.19	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	3.50	-2.00	5.50	6.25	6.25	25.00	-9.50	46.00	-9.50
KTB 2*10Y	33.80	-2.90	36.70	36.30	27.00	42.80	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	16.45	0.00	16.45	17.68	19.32	34.56	-23.40	147.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6y 23.25
06M			
09M			
01Y	28		
1.5Y	27.25 / 27.75		
02Y		SPRD	
03Y	24		
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	28.75		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3*5y CCR -3		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	102 건	-19	121	76	95	126	61	140
금 액	41,048 억원	-354	41,402	26,100	35,863	60,374	24,910	64,380

장중동향

국고채 금리. 코로나19 상황이 비상경제 시국이라고 평가 되며 국고채 금리 급락.

IRS. 전 구간 금리 하락. 커브 플래트닝.

CRS. 전 구간 금리 하락 마감.