

IPS Daily Morning Brief

2020-02-20

종가 기준일 2020-02-19

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3550	0.25	1.3605	1.3764	1.4306	1.9125	1.3425	1.9125	1.2875
9M	1.3225	0.00	1.3315	1.3526	1.4001	1.9125	1.2925	1.9125	1.2500
1Y	1.2975	-0.25	1.3085	1.3350	1.3800	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2775	0.00	1.2900	1.3206	1.3576	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.2525	0.00	1.2680	1.3035	1.3340	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.2450	0.00	1.2650	1.3004	1.3305	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.2450	0.00	1.2680	1.3073	1.3360	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.2425	0.00	1.2680	1.3098	1.3371	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.2400	0.00	1.2705	1.3138	1.3393	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.2650	-0.25	1.3040	1.3451	1.3701	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.2775	-0.25	1.3170	1.3575	1.3811	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.2625	-0.25	1.3015	1.3413	1.3633	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.1725	-0.25	1.2145	1.2606	1.2678	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-3.25	-0.25	-2.90	-2.38	-3.05	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-2.50	-0.25	-2.30	-1.76	-2.00	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-4.50	0.25	-4.05	-3.15	-4.60	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-0.75	0.00	-0.30	-0.31	-0.36	6.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-0.75	0.00	0.00	0.38	0.20	10.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-1.00	0.00	0.00	0.63	0.31	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	0.00	0.00	0.30	0.69	0.56	4.75	-3.25	8.75	-3.25
3*5Y	-0.25	0.00	0.30	0.94	0.67	8.50	-5.25	16.00	-5.25
4*5Y	-0.25	0.00	0.00	0.25	0.11	3.75	-2.25	7.25	-2.25
5*7Y	-0.25	0.00	0.25	0.40	0.22	4.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	2.25	-0.25	3.60	3.54	3.30	11.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	2.50	-0.25	3.35	3.14	3.08	7.25	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.25	0.00	1.30	1.24	1.10	4.00	-1.00	5.75	-1.00
10*15Y	-0.25	0.00	-0.25	-0.39	-0.67	5.25	-3.25	9.00	-3.25
10*20Y	-9.25	0.00	-8.95	-8.45	-10.23	6.00	-16.00	12.00	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.238	-0.40	1.253	1.277	1.338	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.245	-0.50	1.263	1.305	1.363	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.260	1.00	1.264	1.308	1.367	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.281	1.10	1.293	1.324	1.319	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.340	0.00	1.364	1.398	1.455	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.375	-0.20	1.406	1.434	1.472	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.482	0.00	1.519	1.544	1.583	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.555	0.00	1.597	1.616	1.647	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.570	-0.70	1.614	1.637	1.644	2.420	0.705	2.792	0.705

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.80	-0.03	110.81	110.93	110.61
LKTb	131.80	0.00	131.70	132.25	131.22

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	5.95	0.15	5.57	5.78	4.20	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	3.25	0.50	2.70	1.55	-0.53	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-0.75	-1.00	0.42	-0.41	-3.34	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-3.60	-1.10	-2.76	-2.34	1.13	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-9.50	0.00	-9.64	-9.11	-11.92	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-13.25	0.20	-13.82	-12.38	-13.45	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-24.20	0.00	-24.87	-23.07	-24.39	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-29.00	-0.25	-29.34	-27.12	-27.70	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-39.75	0.45	-39.93	-37.65	-37.65	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1189.30 (-0.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-55.75	1.75	1Y	0.7400	1.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-9.00	-0.50		
-57.25	1.50	1.5Y	0.7050	1.50	1.3950	1.1000	2*3Y	-4.00	0.00		
-60.25	1.00	2Y	0.6500	1.00	1.3750	1.1000	2*5Y	-8.00	-1.00		
-63.50	1.00	3Y	0.6100	1.00	1.3800	0.0450	3*4Y	-2.00	-0.50		
-65.50	0.50	4Y	0.5900	0.50	1.4000	0.0350	3*5Y	-4.00	-1.00		
-67.25	0.00	5Y	0.5700	0.00	1.4550	0.0150	4*5Y	-2.00	-0.50		
-62.50	0.00	7Y	0.6150	0.00	1.5350	0.0750	5*7Y	4.50	0.00		
-62.00	0.25	10Y	0.6450	0.00	1.7800	0.2550	5*10Y	7.50	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	1.4239	0.0164	1.4075	1.4238	1.4238	2.9773	1.3231	2.9773	0.5600
10Y	1.5662	0.0043	1.5619	1.5883	1.5883	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	16.39	0.64	15.75	14.68	13.38	103.03	2.31	103.03	-85.90
10Y	1.12	0.43	0.69	-2.67	-6.87	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	1.25	-0.25	1.50	3.50	5.50	25.00	-9.50	46.00	-9.50
KTb 2*10Y	29.50	-1.00	30.50	33.80	36.70	42.80	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	14.23	-1.21	15.44	16.45	16.45	34.56	-23.40	144.20	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	6y 21						
06M			9y 22.25						
09M	31.5								
01Y	27.75 / 29 / 29.75 / 29.5								
1.5Y									
02Y	22.25	SPRD							
03Y									
04Y									
05Y	21.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	104 건	-41	145	102	121	76	95	126	
금 액	38,354 억원	-6,234	44,588	41,048	41,402	26,100	35,863	60,374	

장중동향
국고채 금리, 전 구간 금리 하락, 국고 3년물 금리는 상승 마감.

IRS, 국채 선물과 연동해 장 중 큰 폭의 변동성 보여, 강보합 장세

CRS, 중단기 구간 금리 상승 마감.