

IPS Daily Morning Brief

2020-02-24

종가 기준일 2020-02-21

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3125	-1.50	1.3435	1.3654	1.4251	1.9125	1.3125	1.9125	1.2875
9M	1.2750	-2.00	1.3115	1.3395	1.3942	1.9125	1.2750	1.9125	1.2500
1Y	1.2425	-2.75	1.2865	1.3196	1.3738	1.9200	1.2225	1.9200	1.2200
1.5Y	1.2100	-4.00	1.2640	1.3031	1.3514	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.1700	-5.00	1.2360	1.2828	1.3278	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.1525	-6.00	1.2275	1.2775	1.3243	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.1425	-7.00	1.2260	1.2824	1.3299	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.1375	-7.25	1.2235	1.2840	1.3310	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.1350	-7.25	1.2215	1.2869	1.3333	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.1625	-7.00	1.2495	1.3179	1.3640	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.1750	-7.00	1.2620	1.3301	1.3758	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.1600	-7.00	1.2470	1.3141	1.3582	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.0625	-7.75	1.1565	1.2314	1.2636	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125

6*9M	-3.75	-0.50	-3.20	-2.59	-3.10	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.25	-0.75	-2.50	-1.99	-2.03	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-7.25	-2.25	-5.05	-3.69	-4.60	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-1.75	-1.00	-0.85	-0.52	-0.35	6.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-2.75	-2.00	-1.00	-0.04	0.21	10.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-3.25	-2.25	-1.25	0.13	0.32	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	-1.00	-1.00	-0.15	0.49	0.56	4.75	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	-1.50	-1.25	-0.40	0.65	0.68	8.50	-5.25	14.25	-5.25
4*5Y	-0.50	-0.25	-0.25	0.16	0.11	3.75	-2.25	6.75	-2.25
5*7Y	-0.25	0.00	-0.20	0.29	0.23	4.00	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	2.50	0.25	2.60	3.39	3.30	11.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	2.75	0.25	2.80	3.10	3.08	7.25	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.25	0.00	1.25	1.23	1.17	4.00	-1.00	5.75	-1.00
10*15Y	-0.25	0.00	-0.25	-0.37	-0.58	5.25	-3.25	9.00	-3.25
10*20Y	-10.00	-0.75	-9.30	-8.65	-10.05	5.75	-16.00	12.00	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.176	-3.60	1.228	1.262	1.330	1.918	1.136	1.935	1.136
1.5Y	1.177	-4.10	1.234	1.286	1.354	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.177	-4.80	1.238	1.287	1.359	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.187	-5.80	1.259	1.304	1.311	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.238	-6.70	1.321	1.376	1.446	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.270	-7.00	1.357	1.411	1.463	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.379	-7.70	1.467	1.522	1.576	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.447	-8.30	1.540	1.594	1.640	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.477	-7.80	1.563	1.616	1.639	2.420	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.41	0.00
CALL	1.23	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.15	0.20	111.05	111.18	110.99
LKTb	133.04	0.87	132.44	133.14	132.25

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	6.65	0.85	5.83	5.72	4.35	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	3.30	0.10	3.02	1.72	-0.29	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-0.70	-0.20	-0.18	-0.41	-3.09	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-3.45	-0.20	-3.11	-2.62	1.33	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-9.55	-0.30	-9.48	-9.39	-11.61	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-13.25	-0.25	-13.39	-12.66	-13.21	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-24.40	0.45	-24.51	-23.50	-24.23	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-28.45	1.30	-29.09	-27.62	-27.56	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-41.45	0.05	-40.63	-38.47	-37.57	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1209.20 (+10.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-54.75	2.25	1Y	0.6950	-0.50	1.4550	0.3900	1*2Y	-14.00	-4.50		
-57.00	1.50	1.5Y	0.6400	-2.50	1.3950	1.1000	2*3Y	-4.50	0.50		
-61.50	0.00	2Y	0.5550	-5.00	1.3750	1.1000	2*5Y	-7.50	0.50		
-64.25	1.50	3Y	0.5100	-4.50	1.3800	0.0450	3*4Y	-2.50	-1.00		
-65.75	1.50	4Y	0.4850	-5.50	1.4000	0.0350	3*5Y	-3.00	0.00		
-65.75	2.75	5Y	0.4800	-4.50	1.4550	0.0150	4*5Y	-0.50	1.00		
-61.00	2.75	7Y	0.5250	-4.50	1.5350	0.0750	5*7Y	4.50	0.00		
-60.75	2.50	10Y	0.5550	-4.50	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	1.3502	-0.0410	1.3912	1.4239	1.4075	2.9773	1.3231	2.9773	0.5600
10Y	1.4746	-0.0423	1.5169	1.5662	1.5619	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	17.32	0.7	16.62	16.39	15.75	103.03	2.31	103.03	-85.90
10Y	2.76	4.07	-1.31	1.12	0.69	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	-0.75	-2.00	1.25	1.25	1.50	25.00	-9.50	43.75	-9.50
KTb 2*10Y	27.00	-3.50	30.50	29.50	30.50	39.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	12.44	-0.13	12.57	14.23	15.44	34.56	-23.40	142.20	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	26								
1.5Y									
02Y	18.75 / 18.5	SPRD							
03Y									
04Y									
05Y	13.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y 69.5 / 70								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	109 건	-23	132	104	145	102	121	76	
금 액	36,491 억원	-12,431	48,922	38,354	44,588	41,048	41,402	26,100	

장중동향

국고채 금리, 전 구간 금리 급락.

IRS, 전 구간 큰 폭 하락.

CRS, 전 구간 하락, 마감