IPS Daily Morning Brief

2020-02-28

종가 기준일 2020-02-27

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3400	3.50	1.3105	1.3454	1.4148	1.9125	1.2975	1.9125	1.2875
9M	1.2975	4.50	1.2670	1.3143	1.3825	1.9125	1.2525	1.9125	1.2500
1Y	1.2600	4.75	1.2320	1.2895	1.3615	1.9200	1.2125	1.9200	1.2125
1.5Y	1.2225	5.50	1.1910	1.2661	1.3382	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.1875	5.75	1.1505	1.2406	1.3136	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.1625	6.50	1.1245	1.2308	1.3086	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.1475	6.00	1.1155	1.2323	1.3138	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.1350	5.75	1.1080	1.2320	1.3147	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.1275	5.25	1.1045	1.2336	1.3171	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.1525	4.50	1.1325	1.2651	1.3483	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.1650	4.50	1.1450	1.2780	1.3611	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.1450	4.50	1.1260	1.2614	1.3435	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	1.0325	4.50	1.0205	1.1730	1.2498	2.3150	0.9125	2.5600	0.9125
6*9M	-4.25	1.00	-4.35	-3.11	-3.23	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.75	0.25	-3.50	-2.48	-2.10	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-7.25	1.00	-8.15	-4.89	-4.79	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-2.50	0.75	-2.60	-0.99	-0.50	6.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-4.00	0.25	-3.50	-0.84	0.02	10.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-5.25	0.00	-4.25	-0.86	0.11	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	-1.50	-0.50	-0.90	0.15	0.52	4.75	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	-2.75	-0.75	-1.65	0.12	0.61	8.50	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	-1.25	-0.25	-0.75	-0.03	0.09	3.75	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	-0.75	-0.50	-0.35	0.16	0.24	4.00	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	1.75	-1.25	2.45	3.31	3.36	11.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	2.50	-0.75	2.80	3.15	3.12	7.25	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.25	0.00	1.25	1.29	1.28	4.00	-1.00	5.50	-1.00
10*15Y	-0.75	0.00	-0.65	-0.38	-0.48	5.00	-3.25	8.50	-3.25
10*20Y	-12.00	0.00	-11.20	-9.21	-9.85	5.50	-16.00	12.00	-16.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.178	5.00	1.154	1.230	1.313	1.918	1.128	1.935	1.128
1.5Y	1.184	5.00	1.159	1.246	1.336	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.195	5.80	1.162	1.246	1.340	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	0.192	-94.30	0.968	1.213	1.276	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.256	5.50	1.228	1.333	1.427	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.295	5.80	1.262	1.368	1.446	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.390	4.40	1.369	1.480	1.560	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.445	4.00	1.431	1.553	1.624	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.486	4.60	1.459	1.575	1.628	2.420	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.41	0.00
CALL	1.24	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.09	-0.21	111.33	111.38	111.06
LKTB	133.10	-0.40	133.50	133.88	132.95

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	8.20	-0.25	7.82	6.00	4.85	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	3.85	0.50	3.16	2.06	0.24	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-0.75	-0.05	-1.11	-0.49	-2.67	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	97.05	100.80	15.67	1.81	3.23	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-10.85	0.50	-11.25	-10.05	-11.30	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-16.00	-0.05	-15.42	-13.60	-13.10	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-26.25	0.85	-26.43	-24.68	-24.28	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-29.25	0.50	-29.89	-28.78	-27.54	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-45.35	-0.10	-43.89	-40.16	-37.86	52.25	-48.55	52.25	-48.55

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-72.50	-2.75
-71.75	-2.00
-73.25	-0.25
-74.25	-1.00
-73.75	0.00
-73.00	0.25
-66.25	1.25
-65.75	2.00

CRS

USD/KRW 1217.20 (+0.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.5350	2.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-8.00	3.50
1.5Y	0.5050	3.50	1.3950	1.1000	2*3Y	-3.50	0.00
2Y	0.4550	5.50	1.3750	1.1000	2*5Y	-5.00	0.50
3Y	0.4200	5.50	1.3800	0.0450	3*4Y	-1.00	0.50
4Y	0.4100	6.00	1.4000	0.0350	3*5Y	-1.50	0.50
5Y	0.4050	6.00	1.4550	0.0150	4*5Y	-0.50	0.00
7Y	0.4650	6.50	1.5350	0.0750	5*7Y	6.00	0.50
10Y	0.4950	6.50	1.7800	0.2550	5*10Y	9.00	0.50

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	1.0657	-0.1028	1.1685	1.2269	1.2517	2.9773	1.0657	2.9773	0.5600
10Y	1.2665	-0.0664	1.3329	1.3538	1.3738	3.2382	1.2665	3.2382	1.2665

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	-12.93	-16.08	3.15	6.49	11.47	103.03	-12.93	103.03	-85.00
10Y	-17.85	-10.64	-7.21	-8.62	-4.62	98.82	-17.85	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	-1.25	-2.25	-1.25	-1.25	25.00	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	25.00	-1.80	26.80	27.80	28.30	39.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	20.08	3.64	16.44	12.69	12.21	34.56	-23.40	138.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	28.25		
01Y	24 / 24.75		
1.5Y	21.25 / 21.75 / 21.5		
02Y		SPRD	
03Y	11.5		
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	15		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	186 건	62	124	98	133	109	132	104
금 액	109,108 억원	63,731	45,377	43,640	53,672	36,491	48,922	38,354

장중동향

국고채 금리. 금통위 결과 기준금리 동결 및 이주열 총재의 매파적 입장을 나타내며 국고채 금리 급등.

IRS. 전 구간 큰 폭 상승. 3년 금리가 10년 보다 더 올라 커프 플래트닝.

CRS. 전 구간 상승. 마감