

IPS Daily Morning Brief

2020-03-02

종가 기준일 2020-02-28

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.3000	-4.00	1.3080	1.3421	1.4120	1.9125	1.2975	1.9125	1.2875
9M	1.2350	-6.25	1.2590	1.3089	1.3792	1.9125	1.2350	1.9125	1.2350
1Y	1.1975	-6.25	1.2230	1.2830	1.3580	1.9200	1.1975	1.9200	1.1975
1.5Y	1.1400	-8.25	1.1770	1.2574	1.3341	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.0800	-10.75	1.1325	1.2298	1.3090	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.0425	-12.00	1.1025	1.2186	1.3034	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.0200	-12.75	1.0910	1.2190	1.3082	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	0.9975	-13.75	1.0800	1.2178	1.3087	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	0.9825	-14.50	1.0740	1.2188	1.3108	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.0050	-14.75	1.1010	1.2503	1.3419	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.0150	-15.00	1.1130	1.2630	1.3549	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	0.9950	-15.00	1.0930	1.2463	1.3373	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	0.8625	-17.00	0.9805	1.1554	1.2434	2.3150	0.8625	2.5600	0.8625

6*9M	-6.50	-2.25	-4.90	-3.33	-3.29	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.75	0.00	-3.60	-2.59	-2.12	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-11.75	-4.50	-9.05	-5.33	-4.90	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-3.75	-1.25	-3.00	-1.11	-0.56	6.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-6.00	-2.00	-4.15	-1.08	-0.08	10.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-8.25	-3.00	-5.25	-1.20	-0.03	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	-2.25	-0.75	-1.15	0.04	0.48	4.75	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	-4.50	-1.75	-2.25	-0.09	0.53	8.50	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	-2.25	-1.00	-1.10	-0.13	0.05	3.75	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	-1.50	-0.75	-0.60	0.10	0.21	4.00	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	0.75	-1.00	2.10	3.25	3.32	11.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	2.25	-0.25	2.70	3.15	3.11	7.25	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.00	-0.25	1.20	1.28	1.30	3.75	-1.00	5.50	-1.00
10*15Y	-1.00	-0.25	-0.80	-0.40	-0.46	4.75	-3.25	8.25	-3.25
10*20Y	-14.25	-2.25	-12.05	-9.49	-9.85	5.25	-16.00	11.75	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.145	-3.30	1.148	1.224	1.309	1.918	1.128	1.935	1.128
1.5Y	1.124	-6.00	1.149	1.237	1.331	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.115	-8.00	1.149	1.236	1.335	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.100	90.80	0.950	1.202	1.271	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.145	-11.10	1.209	1.321	1.421	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.170	-12.50	1.242	1.357	1.440	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.274	-11.60	1.348	1.469	1.554	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.327	-11.80	1.407	1.541	1.617	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.380	-10.60	1.440	1.564	1.624	2.420	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.41	0.00
CALL	1.26	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.43	0.34	111.17	111.43	111.16
LKTb	134.32	1.22	133.35	134.36	133.33

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	5.25	-2.95	7.54	5.95	4.89	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	1.60	-2.25	2.82	2.06	0.31	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-3.50	-2.75	-1.67	-0.66	-2.61	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-5.75	-102.80	15.21	1.66	3.26	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-12.50	-1.65	-11.84	-10.20	-11.25	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-17.25	-1.25	-16.22	-13.90	-13.10	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-29.15	-2.90	-27.38	-25.04	-24.34	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-32.20	-2.95	-30.64	-29.10	-27.56	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-51.75	-6.40	-45.95	-40.82	-38.03	52.25	-51.75	52.25	-51.75

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1213.70 (-3.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-74.25	-1.75	1Y	0.4550	-8.00	1.4550	0.3900	1*2Y	-8.50	-0.50		
-71.50	0.25	1.5Y	0.4250	-8.00	1.3950	1.1000	2*3Y	-3.00	0.50		
-71.00	2.25	2Y	0.3700	-8.50	1.3750	1.1000	2*5Y	-4.00	1.00		
-70.25	4.00	3Y	0.3400	-8.00	1.3800	0.0450	3*4Y	-1.00	0.00		
-69.00	4.75	4Y	0.3300	-8.00	1.4000	0.0350	3*5Y	-1.00	0.50		
-66.75	6.25	5Y	0.3300	-7.50	1.4550	0.0150	4*5Y	0.00	0.50		
-59.25	7.00	7Y	0.3900	-7.50	1.5350	0.0750	5*7Y	6.00	0.00		
-58.50	7.25	10Y	0.4200	-7.50	1.7800	0.2550	5*10Y	9.00	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	0.9269	-0.1388	1.0657	1.1685	1.2269	2.9773	0.9269	2.9773	0.5600
10Y	1.1560	-0.1105	1.2665	1.3329	1.3538	3.2382	1.1560	3.2382	1.1560

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	-18.81	-5.88	-12.93	3.15	6.49	103.03	-18.81	103.03	-85.00
10Y	-17.10	0.75	-17.85	-7.21	-8.62	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	-7.50	-4.00	-3.50	-2.25	-1.25	25.00	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	21.20	-3.80	25.00	26.80	27.80	39.50	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	22.91	2.83	20.08	16.44	12.69	34.56	-23.40	138.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	19.75								
1.5Y									
02Y		SPRD	10*15y -0.75						
03Y	5.5 / 6.25		1.5*2y -5.75						
04Y	4								
05Y	6.5 / 1.75 / 1.5 / 02								
07Y	1								
10Y	2.75								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	131 건	-55	186	124	98	133	109	132	
금 액	39,429 억원	-69,679	109,108	45,377	43,640	53,672	36,491	48,922	

장중동향
국고채 금리, 전 구간 금리 급락.

IRS, 전 구간 큰 폭 하락.

CRS, 전 구간 하락, 마감