

IPS Daily Morning Brief

2020-03-03

종가 기준일 2020-03-02

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.2800	-2.00	1.3045	1.3381	1.4090	1.9125	1.2800	1.9125	1.2800
9M	1.2225	-1.25	1.2525	1.3033	1.3756	1.9125	1.2225	1.9125	1.2225
1Y	1.1850	-1.25	1.2155	1.2764	1.3542	1.9200	1.1850	1.9200	1.1850
1.5Y	1.1375	-0.25	1.1690	1.2494	1.3300	1.9675	1.1350	2.0250	1.1350
2Y	1.0850	0.50	1.1230	1.2203	1.3045	2.0175	1.0700	2.1150	1.0700
3Y	1.0475	0.50	1.0910	1.2080	1.2982	2.0775	1.0150	2.2225	1.0150
4Y	1.0350	1.50	1.0780	1.2076	1.3028	2.1250	0.9875	2.2950	0.9875
5Y	1.0250	2.75	1.0660	1.2060	1.3031	2.1625	0.9775	2.3400	0.9775
7Y	1.0150	3.25	1.0585	1.2066	1.3050	2.1975	0.9725	2.3950	0.9725
10Y	1.0400	3.50	1.0850	1.2380	1.3360	2.2675	0.9925	2.4850	0.9925
12Y	1.0500	3.50	1.0965	1.2506	1.3493	2.3050	1.0125	2.5225	1.0125
15Y	1.0300	3.50	1.0765	1.2338	1.3317	2.3150	0.9925	2.5400	0.9925
20Y	0.9000	3.75	0.9585	1.1404	1.2377	2.3150	0.8625	2.5600	0.8625

6*9M	-5.75	0.75	-5.20	-3.49	-3.34	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.75	0.00	-3.70	-2.69	-2.14	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-10.00	1.75	-9.25	-5.61	-4.98	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-3.75	0.00	-3.20	-1.23	-0.63	6.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-5.00	1.00	-4.50	-1.26	-0.17	10.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-6.00	2.25	-5.70	-1.43	-0.14	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	-1.25	1.00	-1.30	-0.04	0.45	4.75	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	-2.25	2.25	-2.50	-0.20	0.49	8.50	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	-1.00	1.25	-1.20	-0.16	0.03	3.75	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	-1.00	0.50	-0.75	0.06	0.19	3.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	1.50	0.75	1.90	3.20	3.30	10.50	0.50	22.25	0.50
7*10Y	2.50	0.25	2.65	3.14	3.11	7.25	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.00	0.00	1.15	1.26	1.33	3.75	-1.00	5.50	-1.00
10*15Y	-1.00	0.00	-0.85	-0.43	-0.44	4.75	-3.25	8.25	-3.25
10*20Y	-14.00	0.25	-12.65	-9.76	-9.84	4.75	-16.00	11.75	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.156	1.10	1.150	1.219	1.305	1.918	1.128	1.935	1.128
1.5Y	1.136	1.20	1.146	1.230	1.326	2.012	1.122	2.113	1.122
2Y	1.125	1.00	1.147	1.229	1.330	2.055	1.089	2.230	1.089
3Y	1.125	2.50	0.946	1.194	1.265	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.175	3.00	1.203	1.312	1.415	2.227	1.127	2.502	1.127
5Y	1.210	4.00	1.237	1.348	1.434	2.282	1.122	2.602	1.122
7Y	1.317	4.30	1.341	1.461	1.549	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.375	4.80	1.398	1.532	1.611	2.445	1.170	2.815	1.170
20Y	1.425	4.50	1.437	1.555	1.619	2.420	0.705	2.792	0.705

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.38	-0.05	111.62	111.66	111.33
LKTb	133.82	-0.50	135.00	135.22	133.65

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	2.90	-2.35	6.55	5.77	4.90	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	0.15	-1.45	2.28	1.98	0.37	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-4.00	-0.50	-2.38	-0.83	-2.55	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-7.75	-2.00	14.46	1.42	3.29	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-14.00	-1.50	-12.54	-10.41	-11.19	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-18.50	-1.25	-17.08	-14.25	-13.10	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-30.20	-1.05	-28.29	-25.40	-24.37	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-33.50	-1.30	-31.34	-29.42	-27.54	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-52.50	-0.75	-47.81	-41.50	-38.16	52.25	-52.50	52.25	-52.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1193.70 (-20.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-80.00	-5.75	1Y	0.3850	-7.00	1.4550	0.3850	1*2Y	-7.00	1.50		
-77.25	-5.75	1.5Y	0.3650	-6.00	1.3950	1.1000	2*3Y	-2.50	0.50		
-77.00	-6.00	2Y	0.3150	-5.50	1.3750	1.1000	2*5Y	-2.50	1.50		
-75.75	-5.50	3Y	0.2900	-5.00	1.3800	0.0450	3*4Y	0.50	1.50		
-74.00	-5.00	4Y	0.2950	-3.50	1.4000	0.0350	3*5Y	0.00	1.00		
-73.50	-6.75	5Y	0.2900	-4.00	1.4550	0.0150	4*5Y	-0.50	-0.50		
-66.00	-6.75	7Y	0.3550	-3.50	1.5350	0.0750	5*7Y	6.50	0.50		
-65.50	-7.00	10Y	0.3850	-3.50	1.7800	0.2550	5*10Y	9.50	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	0.9108	-0.0161	0.9269	1.0657	1.1685	2.9773	0.9108	2.9773	0.5600
10Y	1.1665	0.0105	1.1560	1.2665	1.3329	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	-21.42	-2.61	-18.81	-12.93	3.15	103.03	-21.42	103.03	-85.00
10Y	-20.85	-3.75	-17.10	-17.85	-7.21	98.82	-20.85	98.82	-24.46

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-4.50	3.00	-7.50	-3.50	-2.25	25.00	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	25.00	3.80	21.20	25.00	26.80	39.30	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	25.57	2.66	22.91	20.08	16.44	34.56	-23.40	138.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	22.25								
01Y	19 / 18.75 / 17.75 / 17.5								
1.5Y									
02Y		SPRD	10*20y -14						
03Y									
04Y									
05Y									
07Y									
10Y	97.5 / 97.25 / 97 / 00.25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	114 건	-17	131	186	124	98	133	109	
금 액	33,020 억원	-6,409	39,429	109,108	45,377	43,640	53,672	36,491	

장중동향

국고채 금리. 최근 강세에 따른 차익실현성 매도와 익일 예정 된 국고채 30년물 입찰이 더해진 전 구간 상승 마감.

IRS. 단기는 하락, 장기는 상승하며 커브 스티프닝 나타냄. 혼조세

CRS. 전 구간 큰 폭 하락. 마감