

IPS Daily Morning Brief

2020-03-05

종가 기준일 2020-03-04

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.2075	-5.00	1.2770	1.3238	1.4014	1.9125	1.2075	1.9125	1.2075
9M	1.1375	-6.25	1.2185	1.2848	1.3671	1.9125	1.1375	1.9125	1.1375
1Y	1.0775	-8.00	1.1755	1.2545	1.3449	1.9200	1.0775	1.9200	1.0775
1.5Y	1.0250	-9.00	1.1280	1.2243	1.3200	1.9675	1.0250	2.0250	1.0250
2Y	0.9800	-9.00	1.0805	1.1925	1.2938	2.0175	0.9800	2.1150	0.9800
3Y	0.9500	-9.00	1.0485	1.1780	1.2868	2.0775	0.9500	2.2225	0.9500
4Y	0.9500	-9.00	1.0385	1.1766	1.2914	2.1250	0.9500	2.2950	0.9500
5Y	0.9450	-8.75	1.0270	1.1738	1.2916	2.1625	0.9450	2.3400	0.9450
7Y	0.9425	-8.50	1.0190	1.1738	1.2935	2.1975	0.9425	2.3950	0.9425
10Y	0.9750	-8.00	1.0455	1.2051	1.3248	2.2675	0.9750	2.4850	0.9750
12Y	0.9850	-8.00	1.0560	1.2175	1.3382	2.3050	0.9850	2.5225	0.9850
15Y	0.9600	-8.50	1.0350	1.2001	1.3205	2.3150	0.9600	2.5400	0.9600
20Y	0.8275	-8.75	0.9075	1.1016	1.2262	2.3150	0.8275	2.5600	0.8275

6*9M	-7.00	-1.25	-5.85	-3.90	-3.43	6.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-6.00	-1.75	-4.30	-3.03	-2.22	6.25	-7.00	10.50	-7.00
1*2Y	-9.75	-1.00	-9.50	-6.20	-5.11	13.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-3.00	0.00	-3.20	-1.45	-0.70	6.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-3.00	0.00	-4.20	-1.59	-0.24	10.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-3.50	0.25	-5.35	-1.88	-0.22	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	0.00	0.00	-1.00	-0.14	0.46	4.75	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	-0.50	0.25	-2.15	-0.43	0.48	8.50	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	-0.50	0.25	-1.15	-0.29	0.02	3.75	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	-0.25	0.25	-0.80	0.00	0.19	3.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	3.00	0.75	1.85	3.14	3.31	10.50	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.25	0.50	2.65	3.14	3.13	7.25	1.75	12.75	1.75
10*12Y	1.00	0.00	1.05	1.24	1.35	3.75	-1.00	5.50	-1.00
10*15Y	-1.50	-0.50	-1.05	-0.50	-0.42	4.75	-3.25	8.25	-3.25
10*20Y	-14.75	-0.75	-13.80	-10.35	-9.85	4.75	-16.00	11.50	-16.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.078	-6.70	1.140	1.204	1.297	1.918	1.078	1.935	1.078
1.5Y	1.061	-7.00	1.127	1.209	1.316	2.012	1.061	2.113	1.061
2Y	1.047	-7.20	1.120	1.207	1.319	2.055	1.047	2.230	1.047
3Y	1.036	-8.20	0.914	1.169	1.254	2.085	0.092	2.315	0.092
4Y	1.087	-8.50	1.167	1.285	1.403	2.227	1.087	2.502	1.087
5Y	1.120	-9.00	1.201	1.322	1.423	2.282	1.120	2.602	1.120
7Y	1.234	-8.50	1.307	1.434	1.539	2.377	1.163	2.728	1.163
10Y	1.297	-8.30	1.365	1.504	1.601	2.442	1.170	2.815	1.170
20Y	1.400	-4.40	1.427	1.533	1.612	2.394	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.40	-1.00
CALL	1.25	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.73	0.34	111.76	111.77	111.60
LKTb	111.73	-22.07	111.76	111.77	111.60

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	-0.05	-1.30	3.51	5.09	4.84	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-3.60	-2.00	0.08	1.50	0.37	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-6.70	-1.80	-3.97	-1.45	-2.55	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-8.60	-0.80	13.43	0.88	3.26	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-13.70	-0.50	-12.85	-10.81	-11.15	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-17.50	0.25	-17.40	-14.84	-13.19	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-29.15	0.00	-28.78	-26.04	-24.53	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-32.20	0.30	-31.93	-29.92	-27.62	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-57.25	-4.35	-51.95	-43.17	-38.63	52.25	-57.25	52.25	-57.25

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1187.80 (-7.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-78.75	2.50	1Y	0.2900	-5.50	1.4550	0.2900	1*2Y	-11.50	-4.00		
-77.50	2.00	1.5Y	0.2500	-7.00	1.3950	1.1000	2*3Y	-1.00	-0.50		
-80.50	-0.50	2Y	0.1750	-9.50	1.3750	1.1000	2*5Y	0.00	-0.50		
-78.50	-1.00	3Y	0.1650	-10.00	1.3800	0.0450	3*4Y	0.00	0.00		
-78.50	-1.00	4Y	0.1650	-10.00	1.4000	0.0350	3*5Y	1.00	0.00		
-77.00	-1.25	5Y	0.1750	-10.00	1.4550	0.0150	4*5Y	1.00	0.00		
-68.25	-1.50	7Y	0.2600	-10.00	1.5350	0.0750	5*7Y	8.50	0.00		
-64.00	-2.00	10Y	0.3350	-10.00	1.7800	0.2550	5*10Y	16.00	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	0.6966	-0.0005	0.6971	0.9108	0.9269	2.9773	0.6966	2.9773	0.5600
10Y	1.0619	0.0645	0.9974	1.1665	1.1560	3.2382	0.9974	3.2382	0.9974

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	-35.04	7.15	-42.19	-21.42	-18.81	103.03	-42.19	103.03	-85.00
10Y	-23.51	14.75	-38.26	-20.85	-17.10	98.82	-38.26	98.82	-38.26

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-0.50	1.00	-1.50	-4.50	-7.50	25.00	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	25.00	-1.10	26.10	25.00	21.20	38.70	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	36.53	6.50	30.03	25.57	22.91	36.53	-23.40	138.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	19.5 / 19								
09M	13.5								
01Y									
1.5Y									
02Y	98 / 97.75 / 97				SPRD	6*9m -6			
03Y						3*5y -0.5			
04Y									
05Y	94.25 / 94.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1.5*3y CCS -5								
	1.5*3y CCS -6.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	141 건	38	103	114	131	186	124	98	
금 액	54,842 억원	10,812	44,030	33,020	39,429	109,108	45,377	43,640	

장중동향
국고채 금리. 미연준 기준금리 50bp 인하에 한국은행을 향한 정책 공조 기대감이 시장에 강세로 이어지며 전 구간 금리 급락.

IRS. 미연준 기준금리 인하에 따른 금리 급락.

CRS. 전 구간 하락세. 마감