IPS Daily Morning Brief

2020-03-31

종가 기준일 2020-03-30

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0275	1.00	1.0475	1.1133	1.2916	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9975	1.00	1.0190	1.0659	1.2548	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9750	1.00	0.9975	1.0268	1.2286	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9750	1.75	0.9915	1.0104	1.2087	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9750	3.25	0.9880	1.0030	1.1906	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	0.9875	3.25	0.9895	1.0006	1.1849	1.9650	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	1.0125	3.25	1.0200	1.0263	1.1958	1.9950	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	1.0200	4.25	1.0255	1.0375	1.1993	2.0250	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	1.0125	3.50	1.0230	1.0341	1.1993	2.0575	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.0500	3.50	1.0575	1.0659	1.2301	2.1225	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.0050	3.50	1.0095	1.0245	1.2250	2.1525	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9450	3.50	0.9385	0.9629	1.1926	2.1550	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7950	3.50	0.7875	0.8058	1.0795	2.1625	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-3.00	0.00	-2.85	-4.74	-3.68	3.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-2.25	0.00	-2.15	-3.91	-2.63	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	0.00	2.25	-0.95	-2.38	-3.80	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	1.25	0.00	0.15	-0.24	-0.57	4.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	3.75	0.00	3.20	2.33	0.52	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	4.50	1.00	3.75	3.45	0.88	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.50	0.00	3.05	2.56	1.09	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	3.25	1.00	3.60	3.69	1.45	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	0.75	1.00	0.55	1.13	0.35	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	-0.75	-0.75	-0.25	-0.34	0.00	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	3.00	-0.75	3.20	2.84	3.08	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.75	0.00	3.45	3.18	3.08	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-4.50	0.00	-4.80	-4.14	-0.51	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-10.50	0.00	-11.90	-10.30	-3.75	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-25.50	0.00	-27.00	-26.01	-15.06	4.00	-35.00	11.25	-35.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.026	1.50	0.999	1.011	1.184	1.918	0.878	1.935	0.878
1.5Y	1.039	1.20	1.017	1.029	1.205	1.938	0.930	2.113	0.930
2Y	1.087	3.00	1.088	1.077	1.225	1.967	0.972	2.230	0.972
3Y	1.105	3.80	1.096	1.038	1.202	1.981	0.022	2.315	0.022
4Y	1.317	4.90	1.329	1.247	1.340	2.082	1.070	2.502	1.070
5Y	1.327	5.70	1.342	1.267	1.366	2.115	1.110	2.602	1.110
7Y	1.447	3.90	1.467	1.394	1.485	2.216	1.163	2.728	1.163
10Y	1.567	3.00	1.590	1.491	1.561	2.292	1.170	2.815	1.170
20Y	1.670	4.10	1.684	1.550	1.593	2.240	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.10	0.00
CALL	0.75	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.30	-0.15	111.45	111.48	111.30
LKTB	131.50	-0.32	131.90	132.28	131.46

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	-5.10	-0.50	-0.19	1.54	4.47	12.25	-7.50	12.25	-17.75
1.5Y	-6.40	0.55	-2.59	-1.90	0.39	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-11.20	0.25	-10.04	-7.37	-3.49	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-11.75	-0.55	-10.67	-3.73	-1.70	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-30.45	-1.65	-30.88	-22.08	-14.37	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-30.70	-1.45	-31.65	-22.97	-16.68	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-43.45	-0.40	-44.44	-35.97	-28.55	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-51.70	0.50	-53.27	-42.49	-33.07	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-87.50	-0.60	-89.63	-74.44	-51.37	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-142.00	-9.00
-129.50	-15.25
-123.00	-21.75
-114.25	-24.25
-117.25	-24.25
-117.50	-25.25
-108.25	-24.50
-91.00	-24.50

CRS

USD/KRW 1224.40 (+13.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-0.4450	-8.00	1.3950	-1.4500	1*2Y	19.00	-10.50
1.5Y	-0.3200	-13.50	1.3500	1.1000	2*3Y	10.00	-2.50
2Y	-0.2550	-18.50	1.3200	1.1000	2*5Y	10.00	-2.50
3Y	-0.1550	-21.00	1.3200	-0.5650	3*4Y	-0.50	0.00
4Y	-0.1600	-21.00	1.3300	-0.4750	3*5Y	0.00	0.00
5Y	-0.1550	-21.00	1.3750	-0.3850	4*5Y	0.50	0.00
7Y	-0.0700	-21.00	1.4400	-0.2250	5*7Y	8.50	0.00
10Y	0.1400	-21.00	1.6300	-0.1250	5*10Y	29.50	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	0.2301	-0.0158	0.2459	0.3087	0.3360	2.9773	0.2301	2.9773	0.2301
10Y	0.7225	0.0392	0.6833	0.8519	0.8617	3.2382	0.5685	3.2382	0.5685

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	-85.69	-4.58	-81.11	-76.13	-76.20	103.03	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-84.45	0.92	-85.37	-65.21	-75.93	98.82	-94.90	98.82	-94.90

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	7.50	0.25	7.25	0.50	7.00	20.50	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	48.00	0.00	48.00	43.40	52.30	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	49.24	5.50	43.74	54.32	52.57	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y	96.5		
1.5Y			
02Y	94.75	SPRD	3*5y 2.25
03Y			
04Y			
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	44 건	-62	106	101	96	85	33	116
금 액	18,570 억원	-10,682	29,252	22,123	29,098	20,985	7,447	29,923

장중동향

국고채 금리. 국고채 30년물 입찰을 앞두고 수급 부담이 작용하는 가운데 2차 추경 편성 소식까지 더해지면서 국고채 금리 상승.

IRS. 정부가 내놓은 2차 추경 계획에 따른 국고채 물량 부담에 금리가 올라 전 구간 상승. 거래가 많지 않았고,국채 현물과 선물의 흐름을 따라 움직였으며 오후 들어 추경 관련 홍남기 부총리의 발언에 금리가 추가로 상승.

CRS. 전 구간 하락. 마감