

IPS Daily Morning Brief

2020-03-11

종가 기준일 2020-03-10

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.2550	2.00	1.2365	1.3025	1.3865	1.9125	1.2075	1.9125	1.2075
9M	1.1750	2.75	1.1605	1.2534	1.3494	1.9125	1.1375	1.9125	1.1375
1Y	1.1075	3.50	1.0965	1.2144	1.3247	1.9200	1.0725	1.9200	1.0725
1.5Y	1.0650	4.25	1.0495	1.1785	1.2983	1.9475	1.0225	2.0250	1.0225
2Y	1.0225	5.50	1.0040	1.1411	1.2708	1.9875	0.9675	2.1150	0.9675
3Y	0.9800	6.00	0.9675	1.1191	1.2614	2.0325	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	0.9675	6.25	0.9615	1.1149	1.2655	2.0725	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	0.9575	7.00	0.9530	1.1090	1.2652	2.1050	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	0.9475	7.00	0.9475	1.1061	1.2669	2.1375	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	0.9650	7.25	0.9725	1.1348	1.2980	2.2000	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	0.9500	7.25	0.9725	1.1440	1.3107	2.2325	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9225	7.00	0.9460	1.1243	1.2925	2.2375	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7650	6.75	0.8010	1.0119	1.1955	2.2375	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-8.00	0.75	-7.60	-4.91	-3.72	5.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-6.75	0.75	-6.40	-3.90	-2.47	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-8.50	2.00	-9.25	-7.33	-5.39	9.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-4.25	0.50	-3.65	-2.20	-0.94	4.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-5.50	0.75	-4.25	-2.63	-0.53	8.75	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-6.50	1.50	-5.10	-3.21	-0.56	12.00	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	-1.25	0.25	-0.60	-0.42	0.41	4.00	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	-2.25	1.00	-1.45	-1.01	0.38	7.25	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	-1.00	0.75	-0.85	-0.59	-0.03	3.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	-1.00	0.00	-0.55	-0.29	0.17	3.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	0.75	0.25	1.95	2.58	3.28	10.50	0.50	22.25	0.50
7*10Y	1.75	0.25	2.50	2.86	3.10	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-1.50	0.00	0.00	0.93	1.27	3.25	-1.50	5.50	-1.50
10*15Y	-4.25	-0.25	-2.65	-1.05	-0.55	4.50	-4.25	8.25	-4.25
10*20Y	-20.00	-0.50	-17.15	-12.29	-10.24	4.00	-20.00	11.50	-20.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.050	0.20	1.064	1.166	1.276	1.918	1.048	1.935	1.048
1.5Y	1.059	1.70	1.059	1.167	1.293	1.990	1.042	2.113	1.042
2Y	1.082	4.70	1.058	1.167	1.297	2.020	1.035	2.230	1.035
3Y	1.085	106.30	0.853	1.072	1.215	2.050	0.022	2.315	0.022
4Y	1.171	10.10	1.114	1.235	1.379	2.166	1.070	2.502	1.070
5Y	1.183	7.30	1.150	1.272	1.401	2.225	1.110	2.602	1.110
7Y	1.308	9.00	1.267	1.384	1.518	2.317	1.163	2.728	1.163
10Y	1.360	10.00	1.327	1.450	1.580	2.380	1.170	2.815	1.170
20Y	1.395	10.50	1.386	1.486	1.598	2.307	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.40	0.00
CALL	1.27	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.42	-0.21	111.54	111.60	111.41
LKTB	133.94	-1.09	134.61	134.66	133.89

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	5.75	3.30	3.29	4.85	4.92	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	0.60	2.55	-0.91	1.11	0.53	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-5.95	0.80	-5.42	-2.62	-2.59	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-10.50	-100.30	11.45	4.68	4.69	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-20.35	-3.85	-15.23	-12.01	-11.32	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-22.55	-0.30	-19.66	-16.30	-13.62	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-36.05	-2.00	-31.95	-27.79	-25.15	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-39.50	-2.75	-35.43	-31.55	-28.23	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-63.00	-3.75	-58.50	-47.38	-40.26	52.25	-63.00	52.25	-63.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1193.20 (-11.00)
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비	
-87.75	-0.50	1Y	0.2300	3.00	1.3950	0.2000	1*2Y	-9.00	3.00	
-91.00	0.25	1.5Y	0.1550	4.50	1.3500	1.1000	2*3Y	1.50	2.00	
-88.25	0.50	2Y	0.1400	6.00	1.3200	1.1000	2*5Y	3.50	1.50	
-82.50	2.00	3Y	0.1550	8.00	1.3200	0.0450	3*4Y	1.50	0.00	
-79.75	1.75	4Y	0.1700	8.00	1.3300	0.0350	3*5Y	2.00	-0.50	
-78.25	0.50	5Y	0.1750	7.50	1.3900	0.0150	4*5Y	0.50	-0.50	
-67.75	0.50	7Y	0.2700	7.50	1.4550	0.0750	5*7Y	9.50	0.00	
-62.00	0.25	10Y	0.3450	7.50	1.6850	0.2550	5*10Y	17.00	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	0.5382	0.1415	0.3967	0.5121	0.6052	2.9773	0.3967	2.9773	0.3967
10Y	0.8093	0.2408	0.5685	0.7670	0.9152	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	-54.38	9.45	-63.83	-55.79	-45.18	103.03	-63.83	103.03	-82.20
10Y	-55.07	14.08	-69.15	-60.30	-43.18	98.82	-69.15	98.82	-69.15

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-5.75	1.75	-7.50	-1.75	-0.25	21.75	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	27.80	5.30	22.50	30.00	29.00	36.70	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	27.11	9.93	17.18	25.49	31.00	36.53	-23.40	138.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	8.5 / 8.75								
1.5Y									
02Y	0.5 / 0.25 / 2.5	SPRD	5*10y 1						
03Y			6m*5y -30						
04Y									
05Y	92								
07Y									
10Y	93.5 / 94								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	130 건	-4	134	166	148	141	103	114	
금 액	36,059 억원	-562	36,621	75,587	70,576	54,842	44,030	33,020	

장중동향
 국고채 금리, 미국 국채 금리가 아시아장에서 큰 폭 상승하고 유가도 반등세를 나타내며 글로벌 시장 움직임에 외국인도 국채선물 을 대규모로 매도하며 국고채 금리 급등.

IRS, 아시아 시장에서의 미 금리 상승 등에 국채선물이 약세를 보이는 등 반등한 영향을 받아 금리 전반적 상승.

CRS, 전 구간 상승. 마감.