

IPS Daily Morning Brief

2020-03-12

종가 기준일 2020-03-11

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.2550	0.00	1.2460	1.2979	1.3831	1.9125	1.2075	1.9125	1.2075
9M	1.1775	0.25	1.1685	1.2463	1.3452	1.9125	1.1375	1.9125	1.1375
1Y	1.1100	0.25	1.1030	1.2053	1.3199	1.9200	1.0725	1.9200	1.0725
1.5Y	1.0700	0.50	1.0585	1.1683	1.2932	1.9475	1.0225	2.0250	1.0225
2Y	1.0350	1.25	1.0150	1.1301	1.2656	1.9875	0.9675	2.1150	0.9675
3Y	0.9950	1.50	0.9765	1.1061	1.2555	2.0300	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	0.9875	2.00	0.9690	1.1010	1.2595	2.0700	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	0.9775	2.00	0.9595	1.0944	1.2590	2.1025	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	0.9675	2.00	0.9525	1.0906	1.2606	2.1350	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	0.9825	1.75	0.9740	1.1180	1.2914	2.1950	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	0.9650	1.50	0.9685	1.1256	1.3036	2.2275	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9400	1.75	0.9420	1.1054	1.2853	2.2325	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7825	1.75	0.7920	0.9890	1.1873	2.2325	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-7.75	0.25	-7.75	-5.16	-3.79	5.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-6.75	0.00	-6.55	-4.10	-2.53	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-7.50	1.00	-8.80	-7.51	-5.43	9.25	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	-4.00	0.25	-3.85	-2.40	-1.00	4.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	-4.75	0.75	-4.60	-2.91	-0.61	8.25	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	-5.75	0.75	-5.55	-3.58	-0.66	11.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	-0.75	0.50	-0.75	-0.51	0.40	4.00	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	-1.75	0.50	-1.70	-1.18	0.34	7.25	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	-1.00	0.00	-0.95	-0.66	-0.05	3.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	-1.00	0.00	-0.70	-0.37	0.16	3.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	0.50	-0.25	1.45	2.36	3.24	10.50	0.50	22.25	0.50
7*10Y	1.50	-0.25	2.15	2.74	3.08	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-1.75	-0.25	-0.55	0.76	1.22	3.25	-1.75	5.50	-1.75
10*15Y	-4.25	0.00	-3.20	-1.26	-0.60	4.50	-4.25	8.25	-4.25
10*20Y	-20.00	0.00	-18.20	-12.90	-10.41	4.00	-20.00	11.50	-20.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.046	-0.40	1.057	1.153	1.270	1.918	1.046	1.935	1.046
1.5Y	1.055	-0.40	1.057	1.153	1.287	1.990	1.042	2.113	1.042
2Y	1.070	-1.20	1.063	1.154	1.291	2.020	1.035	2.230	1.035
3Y	1.075	-1.00	0.861	1.062	1.209	2.041	0.022	2.315	0.022
4Y	1.170	-0.10	1.130	1.225	1.374	2.155	1.070	2.502	1.070
5Y	1.180	-0.30	1.162	1.260	1.397	2.210	1.110	2.602	1.110
7Y	1.306	-0.20	1.281	1.372	1.514	2.308	1.163	2.728	1.163
10Y	1.365	0.50	1.340	1.438	1.576	2.375	1.170	2.815	1.170
20Y	1.410	1.50	1.388	1.476	1.595	2.297	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.40	0.00
CALL	1.24	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.42	0.00	111.46	111.54	111.33
LKTb	133.86	-0.08	133.94	134.35	133.32

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	6.40	0.65	4.58	5.25	4.98	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	1.50	0.90	0.11	1.48	0.61	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-3.50	2.45	-4.78	-2.35	-2.56	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-8.00	2.50	11.57	4.46	4.61	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-18.25	2.10	-16.14	-12.39	-11.43	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-20.25	2.30	-20.21	-16.56	-13.76	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-33.85	2.20	-32.89	-28.17	-25.34	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-38.25	1.25	-36.64	-31.98	-28.47	-7.50	-40.70	-7.50	-40.70
20Y	-62.75	0.25	-59.60	-48.65	-40.78	52.25	-63.00	52.25	-63.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1193.00 (-0.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-90.00	-2.25	1Y	0.2100	-2.00	1.3950	0.2000	1*2Y	-3.00	6.00		
-89.50	1.50	1.5Y	0.1750	2.00	1.3500	1.1000	2*3Y	2.00	0.50		
-85.50	2.75	2Y	0.1800	4.00	1.3200	1.1000	2*5Y	3.50	0.00		
-79.50	3.00	3Y	0.2000	4.50	1.3200	0.0450	3*4Y	1.00	-0.50		
-77.75	2.00	4Y	0.2100	4.00	1.3300	0.0350	3*5Y	1.50	-0.50		
-76.25	2.00	5Y	0.2150	4.00	1.3750	0.0150	4*5Y	0.50	0.00		
-65.75	2.00	7Y	0.3100	4.00	1.4400	0.0750	5*7Y	9.50	0.00		
-59.75	2.25	10Y	0.3850	4.00	1.6600	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	0.5334	-0.0048	0.5382	0.3967	0.5121	2.9773	0.3967	2.9773	0.3967
10Y	0.8719	0.0626	0.8093	0.5685	0.7670	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	-53.66	0.72	-54.38	-63.83	-55.79	103.03	-63.83	103.03	-82.20
10Y	-49.31	5.76	-55.07	-69.15	-60.30	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	-5.25	0.50	-5.75	-7.50	-1.75	21.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	29.50	1.70	27.80	22.50	30.00	36.70	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	33.85	6.74	27.11	17.18	25.49	36.53	-23.40	138.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
06M										
09M										
01Y										
1.5Y										
02Y	1 / 1.25 / 3.5				SPRD	9*12m -7.25				
03Y	96					15*20y -15.25				
04Y						4*10y -0.5				
05Y										
07Y										
10Y	94									
12Y										
15Y										
20Y										
CRS	3y 18 / 20.00									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황			129 건	-1	130	134	166	148	141	103
금 액			43,205 억원	7,146	36,059	36,621	75,587	70,576	54,842	44,030

장중동향
 국고채 금리, 서울 채권시장은 아시아 장에서 미국 국채금리 움직임과 코스피 하락 등을 반영해 한때 강세를 보였지만 장중 수급과 커브 변동성이 크게 작용하면서 금리 상승 마감.

IRS. 장중 전반적으로 하락세를 나타내다 마감 전 미국 국채 금리가 아시아 장에서 낙폭을 줄이면서 이에 연동해 상승 마감.

CRS. 전 구간 상승. 마감.