IPS Daily Morning Brief

2020-03-17

종가 기준일 2020-03-16

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0900	-6.75	1.1985	1.2673	1.3677	1.9125	1.0900	1.9125	1.0900
9M	1.0100	-7.00	1.1205	1.2081	1.3277	1.9125	1.0100	1.9125	1.0100
1Y	0.9400	-7.50	1.0525	1.1603	1.3000	1.9200	0.9400	1.9200	0.9400
1.5Y	0.9275	-9.25	1.0260	1.1233	1.2737	1.9300	0.9275	2.0250	0.9275
2Y	0.9400	-8.50	1.0085	1.0876	1.2472	1.9675	0.9400	2.1150	0.9400
3Y	0.9650	-8.75	0.9995	1.0655	1.2378	2.0100	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	1.0150	-9.50	1.0170	1.0650	1.2432	2.0475	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	1.0450	-11.75	1.0305	1.0625	1.2439	2.0800	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	1.0450	-12.00	1.0250	1.0575	1.2455	2.1175	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.0750	-13.50	1.0515	1.0841	1.2763	2.1850	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	0.9850	-15.50	0.9940	1.0770	1.2834	2.2125	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.8950	-15.50	0.9345	1.0469	1.2619	2.2150	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7250	-15.50	0.7725	0.9185	1.1603	2.2175	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-8.00	-0.25	-7.80	-5.91	-4.00	3.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-7.00	-0.50	-6.80	-4.79	-2.76	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	0.00	-1.00	-4.40	-7.26	-5.29	8.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.50	-0.25	-0.90	-2.21	-0.94	4.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	7.50	-1.00	0.85	-2.26	-0.40	8.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	10.50	-3.25	2.20	-2.51	-0.32	13.75	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	5.00	-0.75	1.75	-0.05	0.54	5.75	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	8.00	-3.00	3.10	-0.30	0.61	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	3.00	-2.25	1.35	-0.25	0.07	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.00	-0.25	-0.55	-0.50	0.15	3.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	3.00	-1.75	2.10	2.16	3.23	10.50	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.00	-1.50	2.65	2.66	3.08	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-9.00	-2.00	-5.75	-0.71	0.72	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-18.00	-2.00	-11.70	-3.73	-1.43	4.50	-18.00	8.25	-18.00
10*20Y	-35.00	-2.00	-27.90	-16.56	-11.60	4.00	-35.00	11.25	-35.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.990	-7.00	1.037	1.118	1.253	1.918	0.990	1.935	0.990
1.5Y	1.006	-8.10	1.052	1.120	1.269	1.956	1.006	2.113	1.006
2Y	1.030	-8.50	1.070	1.123	1.274	1.992	1.030	2.230	1.030
3Y	1.060	-9.10	1.084	1.029	1.228	2.007	0.022	2.315	0.022
4Y	1.203	-9.50	1.199	1.201	1.361	2.122	1.070	2.502	1.070
5Y	1.231	-9.30	1.217	1.232	1.385	2.170	1.110	2.602	1.110
7Y	1.381	-9.60	1.354	1.349	1.504	2.271	1.163	2.728	1.163
10Y	1.517	-10.10	1.447	1.419	1.570	2.342	1.170	2.815	1.170
20Y	1.540	-8.60	1.480	1.459	1.592	2.290	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.39	0.00
CALL	1.27	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.30	0.28	111.65	111.65	111.13
LKTB	131.94	1.04	131.50	132.73	131.49

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	-5.00	-0.50	1.53	4.22	4.73	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-7.85	-1.15	-2.58	0.36	0.46	4.05	-10.60	4.05	-19.10
2Y	-9.00	0.00	-6.19	-3.55	-2.71	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-9.50	0.35	-8.47	3.66	0.94	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-18.80	0.00	-18.24	-13.56	-11.78	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-18.60	-2.45	-18.61	-16.96	-14.13	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-33.60	-2.40	-32.90	-29.11	-25.90	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-44.20	-3.40	-39.57	-33.53	-29.41	-7.50	-44.20	-7.50	-44.20
20Y	-81.50	-6.90	-70.71	-54.06	-43.22	52.25	-81.50	52.25	-81.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-189.00	-16.00
-158.25	2.75
-128.00	18.50
-121.50	22.75
-121.50	25.50
-119.00	28.75
-110.00	29.00
-103.00	30.50

CRS

USD/KRW 1226.00 (+6.70)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-0.9500	-23.50	1.3950	-0.9500	1*2Y	61.00	33.50
1.5Y	-0.6550	-6.50	1.3500	1.1000	2*3Y	9.00	4.00
2Y	-0.3400	10.00	1.3200	1.1000	2*5Y	19.50	7.00
3Y	-0.2500	14.00	1.3200	-0.3900	3*4Y	5.00	2.00
4Y	-0.2000	16.00	1.3300	-0.3600	3*5Y	10.50	3.00
5Y	-0.1450	17.00	1.3750	-0.3150	4*5Y	5.50	1.00
7Y	-0.0550	17.00	1.4400	-0.2250	5*7Y	9.00	0.00
10Y	0.0450	17.00	1.6300	-0.1250	5*10Y	19.00	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	0.3619	-0.1443	0.5062	0.4730	0.5334	2.9773	0.3619	2.9773	0.3619
10Y	0.7340	-0.2473	0.9813	0.7939	0.8719	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	-66.81	-5.93	-60.88	-58.20	-53.66	103.03	-66.81	103.03	-82.20
10Y	-78.30	-14.63	-63.67	-58.21	-49.31	98.82	-78.30	98.82	-78.30

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	13.50	-5.00	18.50	0.50	-5.25	21.75	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	48.70	-1.60	50.30	32.10	29.50	50.30	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	37.21	-10.30	47.51	32.09	33.85	47.51	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	95 / 94.75	SPRD	
03Y			
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	11		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y CCR -90.00 2y CCR -32.5 3y CCR -25		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	69 건	-27	96	170	129	130	134	166
금 액	18,697 억원	-25,332	44,029	48,617	43,205	36,059	36,621	75,587

장중동향

국고채 금리. 미연준이 기준금리를 사실상 제로수준으로 인하하면서 한국은행을 향한 국내 기준금리 인하 기대감도 덩달아 고조되어 강세를 보이며 국고채 금리 급락.

IRS. 거래 자체가 거의 없었으나 외국인의 오퍼 물량이 많고 3년과 5년 구간은 증권의 오퍼도 있었음. 전 구간 하락.

CRS. 1년물을 제외하고 상승. 마감.