

IPS Daily Morning Brief

2020-03-20

종가 기준일 2020-03-19

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0175	8.00	1.0275	1.2100	1.3425	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	1.0200	10.25	0.9865	1.1533	1.3036	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	1.0250	12.25	0.9515	1.1070	1.2765	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	1.0550	15.25	0.9540	1.0741	1.2519	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	1.0900	14.75	0.9785	1.0478	1.2285	1.9525	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	1.1300	14.75	1.0110	1.0323	1.2210	1.9925	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	1.1850	13.75	1.0665	1.0403	1.2286	2.0225	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	1.2250	13.75	1.1040	1.0434	1.2309	2.0550	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	1.2175	13.00	1.1025	1.0383	1.2320	2.0925	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.2500	11.25	1.1410	1.0669	1.2630	2.1600	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.1850	11.75	1.0680	1.0476	1.2658	2.1875	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	1.0900	11.75	0.9750	1.0055	1.2403	2.1875	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.9100	11.75	0.8010	0.8641	1.1343	2.1950	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	0.25	2.25	-4.10	-5.68	-3.88	3.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.50	2.00	-3.50	-4.63	-2.72	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	6.50	2.50	2.70	-5.93	-4.79	7.75	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	4.00	0.00	3.25	-1.55	-0.75	4.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	9.50	-1.00	8.80	-0.75	0.01	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	13.50	-1.00	12.55	-0.44	0.24	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	5.50	-1.00	5.55	0.80	0.76	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	9.50	-1.00	9.30	1.11	0.99	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	4.00	0.00	3.75	0.31	0.23	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	-0.75	-0.75	-0.15	-0.51	0.10	3.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	2.50	-2.50	3.70	2.35	3.21	10.50	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.25	-1.75	3.85	2.86	3.10	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-6.50	0.50	-7.30	-1.93	0.28	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-16.00	0.50	-16.60	-6.14	-2.27	4.50	-18.00	8.25	-18.00
10*20Y	-34.00	0.50	-34.00	-20.28	-12.87	4.00	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.956	7.80	0.953	1.069	1.229	1.918	0.878	1.935	0.878
1.5Y	1.008	6.80	0.994	1.078	1.247	1.956	0.930	2.113	0.930
2Y	1.152	14.20	1.056	1.093	1.257	1.990	0.972	2.230	0.972
3Y	1.198	14.30	1.096	1.003	1.214	2.000	0.022	2.315	0.022
4Y	1.444	20.70	1.270	1.194	1.351	2.097	1.070	2.502	1.070
5Y	1.456	19.40	1.292	1.223	1.377	2.135	1.110	2.602	1.110
7Y	1.575	18.60	1.427	1.341	1.496	2.232	1.163	2.728	1.163
10Y	1.670	16.00	1.548	1.418	1.565	2.302	1.170	2.815	1.170
20Y	1.690	13.80	1.574	1.459	1.589	2.250	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.02	0.00
CALL	0.71	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	110.55	-0.76	111.26	111.28	110.22
LKTB	129.87	-1.83	131.70	131.70	129.02

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	6.90	4.45	-0.17	3.78	4.76	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	4.70	8.45	-4.02	-0.38	0.47	4.70	-10.60	4.70	-19.10
2Y	-6.20	0.55	-7.73	-4.54	-2.80	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-6.80	0.45	-8.48	2.97	0.68	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-25.90	-6.95	-20.33	-15.35	-12.27	-4.50	-27.00	-3.20	-30.35
5Y	-23.10	-5.65	-18.80	-17.93	-14.63	-3.20	-28.50	-2.25	-28.50
7Y	-35.75	-5.60	-32.41	-30.31	-26.42	-7.85	-38.35	-7.50	-38.35
10Y	-42.00	-4.75	-40.74	-35.09	-30.20	-7.50	-44.20	-7.50	-44.20
20Y	-78.00	-2.05	-77.26	-59.49	-45.49	52.25	-81.50	52.25	-81.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1285.70 (+40.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-247.50	-81.75	1Y	-1.4500	-69.50	1.3950	-1.4500	1*2Y	70.50	32.00		
-218.00	-69.75	1.5Y	-1.1250	-54.50	1.3500	1.1000	2*3Y	18.00	3.50		
-183.50	-52.25	2Y	-0.7450	-37.50	1.3200	1.1000	2*5Y	36.00	7.00		
-169.50	-48.75	3Y	-0.5650	-34.00	1.3200	-0.5650	3*4Y	9.00	2.50		
-166.00	-45.25	4Y	-0.4750	-31.50	1.3300	-0.4750	3*5Y	18.00	3.50		
-161.00	-44.25	5Y	-0.3850	-30.50	1.3750	-0.3850	4*5Y	9.00	1.00		
-144.25	-43.50	7Y	-0.2250	-30.50	1.4400	-0.2250	5*7Y	16.00	0.00		
-123.50	-44.75	10Y	0.0150	-33.50	1.6300	-0.1250	5*10Y	40.00	-3.00		

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	0.4828	-0.0649	0.5477	0.4965	0.3619	2.9773	0.3619	2.9773	0.3619
10Y	1.1577	-0.0273	1.1850	1.0793	0.7340	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	-66.92	-20.69	-46.23	-47.55	-66.81	103.03	-66.92	103.03	-82.20
10Y	-51.23	-18.73	-32.50	-34.77	-78.30	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	16.00	-3.50	19.50	13.75	13.50	20.75	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	51.80	1.80	50.00	45.50	48.70	51.80	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	67.49	3.76	63.73	58.28	37.21	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M									
09M									
01Y	2.5 / 1.5								
1.5Y									
02Y	8.25 / 09		SPRD	3*5y 9.5					
03Y	12								
04Y									
05Y									
07Y									
10Y	31 / 25								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	81 건	-41	122	107	69	96	170	129	
금 액	29,345 억원	-3,693	33,038	32,345	18,697	44,029	48,617	43,205	

장중동향
국고채 금리. 코로나19 공포에 주식과 채권, 원화 가치가 동반 하락하는 '트리플 약세' 속에 국고채 금리 급등. 정책 당국과 통화 당국이 시장 안정화 조치를 연이어 내놓았지만 전반적으로 위축된 심리를 되돌리기엔 역부족이었던 것으로 풀이 됨.

IRS. 전 구간 큰 폭 상승. 외국인인 3년 국채선물을 대거 매도한 영향에 단기 구간이 약했으며 10년 구간은 오히려 많았음.

CRS. 전 구간 큰 폭 하락. 마감