

IPS Daily Morning Brief

2020-03-24

종가 기준일 2020-03-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9850	1.00	0.9700	1.1775	1.3264	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9800	1.00	0.9585	1.1243	1.2886	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9800	1.00	0.9505	1.0813	1.2622	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	1.0100	2.00	0.9645	1.0548	1.2396	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	1.0550	2.75	1.0020	1.0368	1.2188	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	1.0750	1.75	1.0340	1.0260	1.2123	1.9650	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	1.1350	1.75	1.0920	1.0408	1.2215	1.9950	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	1.1650	1.25	1.1260	1.0476	1.2248	2.0250	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	1.1700	1.75	1.1250	1.0430	1.2257	2.0575	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.2075	1.50	1.1640	1.0728	1.2568	2.1225	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.1475	1.50	1.0990	1.0463	1.2570	2.1525	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	1.0625	1.50	1.0080	0.9974	1.2291	2.1550	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8875	1.50	0.8320	0.8485	1.1205	2.1625	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-0.50	0.00	-1.15	-5.33	-3.78	3.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.00	0.00	-0.80	-4.30	-2.64	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	7.50	1.75	5.15	-4.45	-4.35	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.00	-1.00	3.20	-1.08	-0.65	4.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	8.00	-1.00	9.00	0.40	0.28	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	11.00	-1.50	12.40	1.09	0.60	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	6.00	0.00	5.80	1.48	0.93	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	9.00	-0.50	9.20	2.16	1.25	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	3.00	-0.50	3.40	0.69	0.33	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.50	0.50	-0.10	-0.46	0.09	3.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	4.25	0.25	3.80	2.51	3.20	10.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.75	-0.25	3.90	2.98	3.12	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-6.00	0.00	-6.50	-2.65	0.01	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-14.50	0.00	-15.60	-7.54	-2.77	4.50	-18.00	8.25	-18.00
10*20Y	-32.00	0.00	-33.20	-22.43	-13.63	4.00	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.971	2.70	0.926	1.049	1.214	1.918	0.878	1.935	0.878
1.5Y	1.013	2.70	0.975	1.062	1.234	1.955	0.930	2.113	0.930
2Y	1.165	5.30	1.082	1.091	1.248	1.985	0.972	2.230	0.972
3Y	1.165	4.00	1.112	1.000	1.207	1.981	0.022	2.315	0.022
4Y	1.470	5.80	1.346	1.216	1.350	2.082	1.070	2.502	1.070
5Y	1.466	6.10	1.355	1.241	1.376	2.115	1.110	2.602	1.110
7Y	1.613	7.80	1.485	1.362	1.496	2.216	1.163	2.728	1.163
10Y	1.737	10.70	1.595	1.443	1.567	2.292	1.170	2.815	1.170
20Y	1.810	11.50	1.641	1.488	1.593	2.240	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.02	0.00
CALL	0.72	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	110.78	-0.18	110.85	111.12	110.74
LKTb	129.25	-1.25	130.00	130.52	129.22

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	0.90	-1.70	2.43	3.23	4.78	12.25	-9.65	12.25	-17.75
1.5Y	-0.30	-0.70	-1.09	-0.69	0.58	4.70	-10.60	4.70	-19.10
2Y	-11.00	-2.55	-8.02	-5.45	-2.93	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-9.00	-2.25	-7.76	2.56	0.57	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-33.50	-4.05	-25.40	-17.50	-12.89	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-30.10	-4.85	-22.92	-19.33	-15.16	-3.20	-30.10	-2.25	-30.10
7Y	-44.30	-6.05	-35.96	-31.93	-27.01	-7.85	-44.30	-7.50	-44.30
10Y	-52.95	-9.20	-43.08	-37.01	-30.97	-7.50	-52.95	-7.50	-52.95
20Y	-92.25	-10.00	-80.94	-63.99	-47.25	52.25	-92.25	52.25	-92.25

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1266.50 (+20.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-197.50	-49.00	1Y	-0.9950	-48.00	1.3950	-1.4500	1*2Y	48.50	23.50		
-170.50	-38.00	1.5Y	-0.6950	-36.00	1.3500	1.1000	2*3Y	10.00	5.00		
-156.50	-27.25	2Y	-0.5100	-24.50	1.3200	1.1000	2*5Y	22.00	5.50		
-148.50	-21.25	3Y	-0.4100	-19.50	1.3200	-0.5650	3*4Y	7.50	0.00		
-147.00	-21.25	4Y	-0.3350	-19.50	1.3300	-0.4750	3*5Y	12.00	0.50		
-145.50	-20.25	5Y	-0.2900	-19.00	1.3750	-0.3850	4*5Y	4.50	0.50		
-130.00	-20.75	7Y	-0.1300	-19.00	1.4400	-0.2250	5*7Y	16.00	0.00		
-109.75	-18.25	10Y	0.1100	-16.75	1.6300	-0.1250	5*10Y	40.00	2.25		

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	0.3183	-0.0252	0.3435	0.4828	0.5477	2.9773	0.3183	2.9773	0.3183
10Y	0.7880	-0.0662	0.8542	1.1577	1.1850	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	-84.67	-7.82	-76.85	-66.92	-46.23	103.03	-84.67	103.03	-84.67
10Y	-94.90	-17.32	-77.58	-51.23	-32.50	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	15.25	-1.25	16.50	16.00	19.50	20.50	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	57.20	5.40	51.80	51.80	50.00	57.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	46.97	-4.10	51.07	67.49	63.73	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	99								
09M	98.5								
01Y	98.5								
1.5Y									
02Y					SPRD				
03Y									
04Y	16								
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y CCR 40 5y CCR -16								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	33 건	-83	116	81	122	107	69	96	
금 액	7,447 억원	-22,476	29,923	29,345	33,038	32,345	18,697	44,029	

장중동향
국고채 금리, 서울 채권시장 전반에서 단기 자금시장 상황에 대한 불안감이 좀처럼 해소되지 않는 가운데 외국인 국채선물 매도 등이 약세 압력을 가한것으로 풀이되며 국고채 금리 급등.

IRS, 스와프 시장 참가자들은 불확실성 확대에 거래가 감소한 가운데 국채선물 시장과 연동한 흐름이 나타나며 금리 스와프 상승.

CRS, 달러-원 약세와 함께 급락, 마감