IPS Daily Morning Brief

2020-03-30

종가 기준일 2020-03-27

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0175	-3.00	1.0390	1.1259	1.2988	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9875	-3.00	1.0155	1.0771	1.2616	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9650	-3.25	0.9985	1.0373	1.2353	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9575	-3.00	0.9985	1.0185	1.2146	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9425	-2.25	1.0040	1.0085	1.1959	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	0.9550	1.25	1.0070	1.0036	1.1898	1.9650	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	0.9800	2.00	1.0445	1.0274	1.2005	1.9950	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	0.9775	2.50	1.0545	1.0378	1.2040	2.0250	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	0.9775	3.50	1.0545	1.0343	1.2043	2.0575	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.0150	4.50	1.0890	1.0654	1.2351	2.1225	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	0.9700	4.50	1.0380	1.0268	1.2308	2.1525	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9100	5.00	0.9620	0.9671	1.1993	2.1550	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7600	5.00	0.8060	0.8110	1.0872	2.1625	0.6975	2.5600	0.6975
6*9M	-3.00	0.00	-2.35	-4.88	-3.71	3.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-2.25	-0.25	-1.70	-3.99	-2.63	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-2.25	1.00	0.55	-2.88	-3.94	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	1.25	3.50	0.30	-0.49	-0.61	4.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	3.75	4.25	4.05	1.89	0.46	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	3.50	4.75	5.05	2.93	0.81	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.50	0.75	3.75	2.38	1.07	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	2.25	1.25	4.75	3.41	1.42	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	-0.25	0.50	1.00	1.04	0.35	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.00	1.00	0.00	-0.35	0.03	3.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	3.75	2.00	3.45	2.76	3.11	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.75	1.00	3.45	3.11	3.08	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-4.50	0.00	-5.10	-3.86	-0.43	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-10.50	0.50	-12.70	-9.83	-3.58	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-25.50	0.50	-28.30	-25.44	-14.79	4.00	-35.00	11.25	-35.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.011	1.80	0.988	1.018	1.189	1.918	0.878	1.935	0.878
1.5Y	1.027	1.90	1.012	1.034	1.210	1.938	0.930	2.113	0.930
2Y	1.057	-1.30	1.104	1.079	1.230	1.967	0.972	2.230	0.972
3Y	1.067	-0.50	1.108	1.039	1.205	1.981	0.022	2.315	0.022
4Y	1.268	-0.70	1.359	1.240	1.341	2.082	1.070	2.502	1.070
5Y	1.270	-1.00	1.370	1.261	1.368	2.115	1.110	2.602	1.110
7Y	1.408	1.30	1.501	1.387	1.487	2.216	1.163	2.728	1.163
10Y	1.537	3.30	1.624	1.481	1.562	2.292	1.170	2.815	1.170
20Y	1.629	3.40	1.712	1.538	1.593	2.240	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.10	0.00
CALL	0.75	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.45	0.12	111.36	111.55	111.35
LKTB	131.82	-0.21	132.05	132.73	131.63

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	-4.60	-5.05	1.01	1.94	4.61	12.25	-7.70	12.25	-17.75
1.5Y	-6.95	-4.90	-1.37	-1.58	0.48	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-11.45	-0.95	-10.00	-7.01	-3.36	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-11.20	1.75	-10.12	-3.53	-1.57	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-28.80	2.70	-31.49	-21.26	-14.08	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-29.25	3.50	-31.53	-22.36	-16.38	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-43.05	2.20	-44.61	-35.31	-28.25	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-52.20	1.20	-53.52	-41.58	-32.67	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-86.90	1.60	-90.58	-72.69	-50.59	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-133.00	16.25
-114.25	6.00
-101.25	-1.25
-90.00	-8.25
-93.00	-11.00
-92.25	-12.00
-83.75	-14.00
-66.50	-17.50

CRS

USD/KRW 1210.60 (-22.20)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-0.3650	13.00	1.3950	-1.4500	1*2Y	29.50	-16.50
1.5Y	-0.1850	3.00	1.3500	1.1000	2*3Y	12.50	-3.50
2Y	-0.0700	-3.50	1.3200	1.1000	2*5Y	12.50	-6.00
3Y	0.0550	-7.00	1.3200	-0.5650	3*4Y	-0.50	-2.00
4Y	0.0500	-9.00	1.3300	-0.4750	3*5Y	0.00	-2.50
5Y	0.0550	-9.50	1.3750	-0.3850	4*5Y	0.50	-0.50
7Y	0.1400	-10.50	1.4400	-0.2250	5*7Y	8.50	-1.00
10Y	0.3500	-13.00	1.6300	-0.1250	5*10Y	29.50	-3.50

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	0.2459	-0.0628	0.3087	0.3360	0.3896	2.9773	0.2459	2.9773	0.2459
10Y	0.6833	-0.1686	0.8519	0.8617	0.8483	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	-81.11	-4.98	-76.13	-76.20	-74.04	103.03	-84.67	103.03	-84.67
10Y	-85.37	-20.16	-65.21	-75.93	-87.37	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	7.25	6.75	0.50	7.00	12.50	20.50	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	48.00	4.60	43.40	52.30	59.20	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	43.74	-10.58	54.32	52.57	45.87	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	99.75	ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	93.5 / 94.75	SPRD	5*10y 1.75
03Y	93		
04Y			
05Y	96.5		
07Y	93		
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	106 건	5	101	96	85	33	116	81
금 액	29,252 억원	7,129	22,123	29,098	20,985	7,447	29,923	29,345

장중동향

국고채 금리. 서울 채권시장은 전일 한국은행의 유동성 정책으로 시장 안정화 기대감 속에서 출발했지만, 여전히 높은 수급 관련 불확실성에 경계감이 작용하면서 강세가 제한적으로 나타나며 국고채 금리 엇갈림. 넉넉지 않은 유동성 사정도 다음 주 국고채 입찰을 앞두고 부담 요인으로 작용.

IRS. 단기 구간은 하락하고 장기구간은 상승해 수익률 곡선이 가팔라짐. 커브 스티프닝

CRS. FX스와프가 안정화 된 영향에 단기 금리 상승. 1년을 제외한 전 구간 하락. 마감