

IPS Daily Morning Brief

2020-04-03

종가 기준일 2020-04-02

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0200	-2.25	1.0250	1.0820	1.2710	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9900	-2.25	0.9935	1.0398	1.2352	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9650	-2.25	0.9685	1.0048	1.2094	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9800	-2.25	0.9760	0.9979	1.1923	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9900	-2.00	0.9785	0.9986	1.1763	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	1.0200	-2.25	1.0010	1.0050	1.1728	1.9375	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	1.0550	-1.75	1.0300	1.0354	1.1852	1.9625	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	1.0675	-1.75	1.0380	1.0491	1.1894	1.9925	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	1.0675	-1.50	1.0360	1.0461	1.1891	2.0250	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.1050	-1.50	1.0740	1.0791	1.2201	2.0875	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.0650	-0.75	1.0295	1.0296	1.2119	2.1175	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	1.0125	-0.50	0.9720	0.9633	1.1777	2.1200	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8725	-0.50	0.8260	0.8048	1.0623	2.1275	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-3.00	0.00	-3.15	-4.23	-3.58	3.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-2.50	0.00	-2.50	-3.50	-2.58	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	2.50	0.25	1.00	-0.61	-3.31	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	3.00	-0.25	2.25	0.64	-0.36	4.25	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	6.50	0.25	5.15	3.68	0.88	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.75	0.25	5.95	5.05	1.30	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.50	0.50	2.90	3.04	1.24	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	4.75	0.50	3.70	4.41	1.66	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.25	0.00	0.80	1.38	0.42	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.00	0.25	-0.20	-0.30	-0.03	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	3.75	0.25	3.60	3.00	3.08	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.75	0.00	3.80	3.30	3.10	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-4.00	0.75	-4.45	-4.95	-0.82	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-9.25	1.00	-10.20	-11.59	-4.25	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-23.25	1.00	-24.80	-27.44	-15.79	4.00	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.954	-4.60	0.999	0.994	1.168	1.918	0.878	1.935	0.878
1.5Y	1.035	-3.30	1.038	1.023	1.191	1.938	0.930	2.113	0.930
2Y	1.030	-3.00	1.060	1.073	1.212	1.950	0.972	2.230	0.972
3Y	1.057	-3.30	1.078	1.039	1.191	1.962	0.022	2.315	0.022
4Y	1.257	-4.40	1.284	1.270	1.334	2.055	1.070	2.502	1.070
5Y	1.300	-3.10	1.305	1.289	1.362	2.082	1.110	2.602	1.110
7Y	1.408	-3.30	1.426	1.416	1.480	2.176	1.163	2.728	1.163
10Y	1.520	-3.50	1.546	1.521	1.559	2.250	1.170	2.815	1.170
20Y	1.635	-2.30	1.652	1.585	1.595	2.195	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.10	0.00
CALL	0.73	-2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.39	0.17	111.26	111.42	111.21
LKTB	131.82	0.32	131.61	131.92	131.39

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	1.10	2.35	-3.03	1.04	4.18	12.25	-7.50	12.25	-17.75
1.5Y	-5.50	1.05	-6.22	-2.50	0.12	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-4.00	1.00	-8.17	-7.47	-3.61	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-3.70	1.05	-7.68	-3.36	-1.80	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-20.20	2.65	-25.40	-23.51	-14.87	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-23.25	1.35	-26.70	-24.02	-17.29	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-34.05	1.80	-39.00	-37.00	-29.07	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-41.50	2.00	-47.22	-44.18	-33.87	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-76.25	1.80	-82.58	-78.02	-53.28	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS		USD/KRW				1228.30 (-2.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-166.50	-7.75	1Y	-0.7000	-10.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	22.00	-4.50
-155.00	-9.75	1.5Y	-0.5700	-12.00	1.3500	1.1000	2*3Y	10.50	0.50
-147.00	-12.50	2Y	-0.4800	-14.50	1.3200	1.1000	2*5Y	7.00	0.50
-139.50	-11.75	3Y	-0.3750	-14.00	1.3150	-0.5650	3*4Y	-2.50	0.00
-145.50	-12.25	4Y	-0.4000	-14.00	1.3250	-0.4750	3*5Y	-3.50	0.00
-147.75	-12.25	5Y	-0.4100	-14.00	1.3700	-0.4100	4*5Y	-1.00	0.00
-137.75	-12.50	7Y	-0.3100	-14.00	1.4350	-0.3100	5*7Y	10.00	0.00
-120.00	-12.00	10Y	-0.0950	-13.50	1.6250	-0.1250	5*10Y	31.50	0.50

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	0.2334	0.0233	0.2101	0.2455	0.2301	2.9773	0.2101	2.9773	0.2101
10Y	0.6088	0.0271	0.5817	0.6774	0.7225	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	-79.66	5.33	-84.99	-82.15	-85.69	103.03	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-91.12	6.21	-97.33	-87.46	-84.45	98.82	-97.33	98.82	-97.33

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	11.50	0.50	11.00	10.50	7.50	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	49.00	-0.50	49.50	48.50	48.00	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	37.54	0.38	37.16	43.19	49.24	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	2								
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y				SPRD					
03Y	2.5								
04Y									
05Y									
07Y									
10Y	11								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y CCR -47								
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	70 건		-1	71	70	44	106	101	96
금 액	24,902 억원		5,786	19,116	19,440	18,570	29,252	22,123	29,098

장중동향
 국고채 금리, 한국은행이 무제한 환매조건부증권(RP) 매입에 나서는 등 정책 기대가 투자심리에 긍정적인 재료로 작용. 다만 정책 수혜를 받는 종목에 따라 채권별 온도차가 갈리며 국고채 금리 하락.

IRS. 채권뿐만 아니라 금융시장 전체적으로 전일 약세를 되돌리는 분위기였으며 단기 오퍼가 많이 나왔음. 10년 등 장기 구간에서 는 비드가 많았으며 전 구간에서 하락.

CRS. 전 구간 하락. 마감