

IPS Daily Morning Brief

2020-04-06

종가 기준일 2020-04-03

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0200	0.00	1.0255	1.0708	1.2641	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9900	0.00	0.9940	1.0305	1.2284	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9650	0.00	0.9685	0.9971	1.2028	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9875	0.75	0.9820	0.9934	1.1863	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	1.0050	1.50	0.9910	0.9970	1.1710	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	1.0350	1.50	1.0170	1.0066	1.1681	1.9375	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	1.0775	2.25	1.0495	1.0393	1.1812	1.9575	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	1.0950	2.75	1.0615	1.0543	1.1857	1.9850	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	1.0975	3.00	1.0600	1.0515	1.1855	2.0175	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.1400	3.50	1.0990	1.0851	1.2166	2.0800	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.1000	3.50	1.0555	1.0331	1.2074	2.1100	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	1.0475	3.50	0.9995	0.9655	1.1726	2.1125	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.9075	3.50	0.8555	0.8070	1.0565	2.1200	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-3.00	0.00	-3.15	-4.03	-3.57	3.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-2.50	0.00	-2.55	-3.34	-2.57	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	4.00	1.50	2.25	-0.01	-3.18	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	3.00	0.00	2.60	0.96	-0.29	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	7.25	0.75	5.85	4.23	1.02	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	9.00	1.25	7.05	5.73	1.47	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	4.25	0.75	3.25	3.26	1.31	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	6.00	1.25	4.45	4.76	1.76	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.75	0.50	1.20	1.50	0.45	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.25	0.25	-0.15	-0.28	-0.03	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	4.50	0.75	3.75	3.09	3.09	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.25	0.50	3.90	3.36	3.11	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-4.00	0.00	-4.35	-5.20	-0.92	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-9.25	0.00	-9.95	-11.96	-4.40	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-23.25	0.00	-24.35	-27.81	-16.01	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	0.00	0.987	0.989	1.162	1.918	0.878	1.935	0.878
1.5Y	1.035	0.00	1.040	1.021	1.186	1.938	0.930	2.113	0.930
2Y	1.030	0.00	1.055	1.071	1.207	1.950	0.972	2.230	0.972
3Y	1.057	0.00	1.076	1.038	1.186	1.962	0.022	2.315	0.022
4Y	1.257	0.00	1.282	1.277	1.331	2.055	1.070	2.502	1.070
5Y	1.300	0.00	1.311	1.295	1.359	2.082	1.110	2.602	1.110
7Y	1.408	0.00	1.426	1.422	1.477	2.176	1.163	2.728	1.163
10Y	1.520	0.00	1.543	1.528	1.557	2.250	1.170	2.815	1.170
20Y	1.635	0.00	1.653	1.595	1.595	2.185	0.705	2.792	0.705

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.35	-0.04	111.41	111.46	111.32
LKTb	131.47	-0.35	131.81	132.13	131.30

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	0.00	-1.89	0.85	4.11	12.25	-7.50	12.25	-17.75
1.5Y	-4.75	0.75	-5.78	-2.79	0.03	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-2.50	1.50	-6.38	-7.44	-3.59	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-2.20	1.50	-5.88	-3.12	-1.75	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-17.95	2.25	-23.23	-23.74	-14.93	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-20.50	2.75	-24.95	-24.11	-17.38	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-31.05	3.00	-36.60	-37.01	-29.13	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-38.00	3.50	-44.38	-44.33	-34.03	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-72.75	3.50	-79.75	-78.85	-53.85	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1230.90 (+2.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-149.50	17.00	1Y	-0.5300	17.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	16.00	-6.00		
-141.75	13.25	1.5Y	-0.4300	14.00	1.3150	1.1000	2*3Y	11.00	0.50		
-137.50	9.50	2Y	-0.3700	11.00	1.2800	1.1000	2*5Y	9.50	2.50		
-129.50	10.00	3Y	-0.2600	11.50	1.2700	-0.5650	3*4Y	-1.00	1.50		
-134.75	10.75	4Y	-0.2700	13.00	1.2800	-0.4750	3*5Y	-1.50	2.00		
-137.00	10.75	5Y	-0.2750	13.50	1.3250	-0.4100	4*5Y	-0.50	0.50		
-127.25	10.50	7Y	-0.1750	13.50	1.3900	-0.3100	5*7Y	10.00	0.00		
-110.00	10.00	10Y	0.0400	13.50	1.5800	-0.1250	5*10Y	31.50	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	0.2170	-0.0164	0.2334	0.2101	0.2455	2.9773	0.2101	2.9773	0.2101
10Y	0.5932	-0.0156	0.6088	0.5817	0.6774	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	-81.30	-1.64	-79.66	-84.99	-82.15	103.03	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-92.68	-1.56	-91.12	-97.33	-87.46	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	13.50	2.00	11.50	11.00	10.50	19.50	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	49.00	0.00	49.00	49.50	48.50	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	37.62	0.08	37.54	37.16	43.19	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	99.5								
02Y	2.5 / 01	SPRD	2*5y 9						
03Y	3 / 4.5								
04Y									
05Y	7.75								
07Y									
10Y	12								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y CCR -38								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	72 건	2	70	71	70	44	106	101	
금 액	16,415 억원	-8,487	24,902	19,116	19,440	18,570	29,252	22,123	

장중동향
국고채 금리, 서울 채권시장이 강세로 출발했지만, 외국인 국채선물 매도세와 다음 주 국고채 5년물 입찰을 앞둔 수급 부담이 약세 압력으로 작용하며 국고채 금리 상승.

IRS. 1년 구간이 하락하고 나머지 구간이 상승해 수익률 곡선이 가팔라짐.(스티프닝)

CRS. 전 구간 상승. 마감