

IPS Daily Morning Brief

2020-04-08

종가 기준일 2020-04-07

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9900	-0.50	1.0135	1.0455	1.2490	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9425	-1.50	0.9785	1.0094	1.2141	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9050	-2.00	0.9495	0.9796	1.1863	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9275	-2.00	0.9690	0.9828	1.1712	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9525	-0.75	0.9835	0.9931	1.1572	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	0.9925	-0.50	1.0175	1.0111	1.1555	1.9375	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	1.0525	-0.50	1.0630	1.0511	1.1703	1.9525	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	1.0850	0.25	1.0830	1.0704	1.1758	1.9775	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	1.0925	0.00	1.0865	1.0695	1.1758	2.0100	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.1500	0.50	1.1320	1.1070	1.2077	2.0775	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.1125	1.00	1.0905	1.0525	1.1968	2.1075	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	1.0600	0.75	1.0380	0.9824	1.1610	2.1100	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.9150	0.50	0.8965	0.8251	1.0435	2.1100	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-4.75	-1.00	-3.50	-3.61	-3.49	3.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.75	-0.50	-2.90	-2.98	-2.78	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	4.75	1.25	3.40	1.35	-2.92	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	4.00	0.25	3.40	1.80	-0.17	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	10.00	0.25	7.95	5.80	1.31	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	13.25	1.00	9.95	7.73	1.86	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	6.00	0.00	4.55	4.00	1.48	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	9.25	0.75	6.55	5.93	2.03	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	3.25	0.75	2.00	1.93	0.55	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.75	-0.25	0.35	-0.09	0.00	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	6.50	0.25	4.90	3.66	3.20	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.75	0.50	4.55	3.75	3.20	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-3.75	0.50	-4.15	-5.45	-1.09	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-9.00	0.25	-9.40	-12.46	-4.67	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-23.50	0.00	-23.55	-28.19	-16.42	3.75	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.853	-1.60	0.926	0.970	1.146	1.918	0.853	1.935	0.853
1.5Y	0.979	-1.60	1.022	1.015	1.173	1.938	0.930	2.113	0.930
2Y	1.003	-0.30	1.026	1.066	1.193	1.950	0.972	2.230	0.972
3Y	1.047	-1.30	1.062	1.088	1.173	1.947	0.022	2.315	0.022
4Y	1.240	-0.70	1.260	1.289	1.321	2.050	1.070	2.502	1.070
5Y	1.317	0.60	1.312	1.312	1.352	2.070	1.110	2.602	1.110
7Y	1.439	1.30	1.424	1.439	1.469	2.158	1.163	2.728	1.163
10Y	1.580	2.90	1.545	1.554	1.553	2.230	1.170	2.815	1.170
20Y	1.662	2.00	1.646	1.626	1.594	2.172	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	111.40	0.00	111.39	111.48	111.37
LKTb	131.19	-0.36	131.46	131.76	131.14

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	5.20	-0.40	2.35	0.98	4.05	12.25	-7.50	12.25	-17.75
1.5Y	-5.15	-0.40	-5.34	-3.22	-0.23	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-5.05	-0.45	-4.23	-7.28	-3.63	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-5.45	0.80	-4.47	-7.67	-1.80	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-18.75	0.20	-19.74	-23.78	-15.08	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-23.20	-0.35	-22.88	-24.17	-17.62	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-34.65	-1.30	-33.79	-36.90	-29.34	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-43.00	-2.40	-41.32	-44.70	-34.48	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-74.70	-1.50	-74.99	-80.13	-55.03	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1221.20 (-8.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-98.00	29.00	1Y	-0.0750	27.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-1.50	-10.00		
-101.25	22.50	1.5Y	-0.0850	20.50	1.3150	1.1000	2*3Y	3.00	-7.00		
-104.25	17.75	2Y	-0.0900	17.00	1.2600	1.1000	2*5Y	1.50	-7.00		
-105.25	10.50	3Y	-0.0600	10.00	1.2650	-0.5650	3*4Y	0.00	0.00		
-111.25	10.50	4Y	-0.0600	10.00	1.2750	-0.4750	3*5Y	-1.50	0.00		
-116.00	9.75	5Y	-0.0750	10.00	1.3200	-0.4100	4*5Y	-1.50	0.00		
-106.75	10.00	7Y	0.0250	10.00	1.3850	-0.3100	5*7Y	10.00	0.00		
-91.00	9.50	10Y	0.2400	10.00	1.5750	-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	0.2680	-0.0002	0.2682	0.2170	0.2334	2.9282	0.2101	2.9773	0.2101
10Y	0.7154	0.0377	0.6777	0.5932	0.6088	3.1838	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	-73.50	0.28	-73.78	-81.30	-79.66	98.32	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-86.46	0.87	-87.33	-92.68	-91.12	97.38	-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	19.75	1.25	18.50	13.50	11.50	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	57.70	3.20	54.50	49.00	49.00	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	44.74	3.79	40.95	37.62	37.54	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	91.5 / 90.5								
1.5Y									
02Y	95	SPRD	3*5y 8.25						
03Y	98.5								
04Y	5.25								
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	123 건	50	73	72	70	71	70	44	
금 액	33,563 억원	14,728	18,835	16,415	24,902	19,116	19,440	18,570	

장중동향
 국고채 금리. 이를 앞으로 다가온 금융통화위원회에 대한 기대에 3년물 금리는 소폭 내렸지만 장기금리는 상승해 국채 수익률 곡선은 가팔라지며 커브 스티프닝 나타난. 장기 금리는 정부와 정치권의 긴급재난지원금 확대 논의가 추정관련 물량 부담으로 작용하면서 상승. 국고채 금리 혼조세.

IRS. 단기는 금리 인하 기대를 반영해 내렸지만, 장기는 소폭 오르며 혼조세를 보임. 오후에 나온 청와대 소식은 재정 확대 우려를 자극해 장기 금리에 약세 압력을 가함.

CRS. 전 구간 큰 폭 상승. 마감