

IPS Daily Morning Brief

2020-04-13

종가 기준일 2020-04-10

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0000	0.25	0.9960	1.0129	1.2278	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9500	0.00	0.9490	0.9808	1.1909	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9100	0.00	0.9120	0.9554	1.1618	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9075	-0.75	0.9240	0.9631	1.1476	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9100	-1.25	0.9365	0.9776	1.1348	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	0.9375	-1.25	0.9695	1.0014	1.1343	1.9375	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	0.9700	-1.25	1.0150	1.0443	1.1503	1.9525	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	0.9900	-1.00	1.0390	1.0643	1.1567	1.9775	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	0.9950	-0.50	1.0445	1.0648	1.1566	2.0100	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.0425	-0.25	1.0955	1.1053	1.1894	2.0775	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.0225	-0.25	1.0660	1.0565	1.1766	2.1075	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9725	-0.25	1.0155	0.9879	1.1393	2.1100	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8375	-0.25	0.8770	0.8345	1.0198	2.1100	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-5.00	-0.25	-4.70	-3.21	-3.69	3.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-4.00	0.00	-3.70	-2.54	-2.91	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	0.00	-1.25	2.45	2.23	-2.69	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.75	0.00	3.30	2.38	-0.05	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	6.00	0.00	7.85	6.66	1.55	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	8.00	0.25	10.25	8.66	2.18	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.25	0.00	4.55	4.29	1.60	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	5.25	0.25	6.95	6.29	2.23	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.00	0.25	2.40	2.00	0.64	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.50	0.50	0.55	0.05	0.00	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	5.25	0.75	5.65	4.10	3.28	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.75	0.25	5.10	4.05	3.28	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-2.00	0.00	-2.95	-4.88	-1.28	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-7.00	0.00	-8.00	-11.74	-5.01	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-20.50	0.00	-21.85	-27.08	-16.97	3.50	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.838	1.00	0.844	0.937	1.121	1.918	0.828	1.935	0.828
1.5Y	0.921	-1.30	0.956	0.996	1.152	1.938	0.921	2.113	0.921
2Y	0.942	-1.00	0.976	1.048	1.172	1.950	0.942	2.230	0.942
3Y	0.970	-2.20	1.017	1.073	1.153	1.947	0.022	2.315	0.022
4Y	1.131	-1.60	1.191	1.281	1.304	2.050	1.070	2.502	1.070
5Y	1.192	-1.00	1.255	1.311	1.337	2.070	1.110	2.602	1.110
7Y	1.315	0.00	1.374	1.435	1.454	2.158	1.163	2.728	1.163
10Y	1.455	1.10	1.509	1.557	1.540	2.230	1.170	2.815	1.170
20Y	1.537	-0.80	1.597	1.637	1.586	2.172	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.10	0.00
CALL	0.73	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.68	0.06	111.65	111.73	111.61
LKTB	132.68	-0.07	132.90	133.15	132.60

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	7.20	-1.00	6.82	1.80	4.11	12.25	-7.50	12.25	-17.75
1.5Y	-1.35	0.55	-3.20	-3.24	-0.40	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-3.20	-0.25	-3.95	-6.99	-3.68	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-3.25	0.95	-4.73	-7.15	-1.90	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-16.10	0.35	-17.56	-23.69	-15.41	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-20.20	0.00	-21.64	-24.69	-18.01	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-32.00	-0.50	-32.97	-37.00	-29.69	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-41.25	-1.35	-41.31	-45.14	-35.09	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-69.95	0.55	-71.96	-80.27	-56.62	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1208.80 (-10.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-97.50	0.50	1Y	-0.0650	0.50	1.3900	-1.4500	1*2Y	-5.50	0.00		
-100.25	1.25	1.5Y	-0.0950	0.50	1.3150	1.1000	2*3Y	2.50	1.00		
-103.00	1.75	2Y	-0.1200	0.50	1.2450	1.1000	2*5Y	1.00	1.00		
-103.25	2.75	3Y	-0.0950	1.50	1.2400	-0.5650	3*4Y	-1.50	0.00		
-108.00	2.75	4Y	-0.1100	1.50	1.2150	-0.4750	3*5Y	-1.50	0.00		
-110.00	2.50	5Y	-0.1100	1.50	1.2500	-0.4100	4*5Y	0.00	0.00		
-100.50	2.00	7Y	-0.0100	1.50	1.3150	-0.3100	5*7Y	10.00	0.00		
-87.25	1.75	10Y	0.1700	1.50	1.5050	-0.1250	5*10Y	28.00	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	0.2201	0.0000	0.2201	0.2560	0.2680	2.8622	0.2101	2.9773	0.2101
10Y	0.7292	0.0000	0.7292	0.7699	0.7154	3.1140	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	-72.19	1	-73.19	-72.10	-73.50	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-72.58	-1.10	-71.48	-74.31	-86.46	91.58	-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	13.25	1.00	12.25	15.75	19.75	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	51.30	2.10	49.20	53.60	57.70	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	50.91	0.00	50.91	51.39	44.74	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M									
09M									
01Y	90.5								
1.5Y									
02Y	91								9*12m -04
03Y	93								1*2y 0.25
04Y									3*4y 03
05Y	98.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	48 건	-24	72	78	123	73	72	70	
금 액	14,844 억원	-6,811	21,655	26,594	33,563	18,835	16,415	24,902	

장중동향

국고채 금리, 서울 채권시장은 비둘기파적 금융통화위원회를 소화하면서 강세를 이어갔지만 다음주 입찰을 앞둔 10년물 구간 금리는 상승. 기획재정부는 오는 13일 3조원 규모의 국고채 10년물 입찰을 실시.

IRS, 1년 구간을 제외하고 전반적으로 하락하는 모습을 보임. 다만 오늘밤 미국장이 성금요일을 맞아 휴장이라 스와프 시장에서는 거래가 뜸했으며, 오후 장들어 국고채 50년물 입찰 영향에 국고채 초장기물 금리가 되돌리면서 IRS 장기 금리도 낙폭을 일부 내춤.

CRS, 전 구간 상승. 마감