

IPS Daily Morning Brief

2020-04-16

종가 기준일 2020-04-14

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0175	0.50	1.0050	1.0131	1.2133	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9725	0.75	0.9565	0.9819	1.1756	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9350	1.00	0.9180	0.9576	1.1458	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9325	0.75	0.9205	0.9664	1.1321	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9325	0.50	0.9260	0.9789	1.1200	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	0.9525	-0.50	0.9535	1.0024	1.1203	1.9375	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	0.9850	-0.50	0.9880	1.0435	1.1372	1.9500	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	1.0050	-0.50	1.0085	1.0628	1.1443	1.9600	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	1.0075	-0.75	1.0120	1.0638	1.1444	1.9875	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.0500	-1.25	1.0590	1.1055	1.1779	2.0525	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.0300	-1.25	1.0375	1.0628	1.1640	2.0825	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9800	-1.25	0.9875	0.9984	1.1258	2.0875	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8450	-1.25	0.8525	0.8485	1.0050	2.0825	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-4.50	0.25	-4.85	-3.13	-3.77	3.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.75	0.25	-3.85	-2.43	-2.98	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-0.25	-0.50	0.80	2.13	-2.58	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.00	-1.00	2.75	2.35	0.03	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	5.25	-1.00	6.20	6.46	1.73	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.25	-1.00	8.25	8.39	2.43	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.25	0.00	3.45	4.11	1.69	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	5.25	0.00	5.50	6.04	2.40	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.00	0.00	2.05	1.93	0.71	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.25	-0.25	0.35	0.10	0.01	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	4.50	-0.75	5.05	4.28	3.36	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.25	-0.50	4.70	4.18	3.35	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-2.00	0.00	-2.15	-4.28	-1.38	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-7.00	0.00	-7.15	-10.71	-5.21	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-20.50	0.00	-20.65	-25.70	-17.29	3.50	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.856	0.50	0.841	0.929	1.104	1.918	0.828	1.935	0.828
1.5Y	0.932	0.00	0.934	0.992	1.136	1.938	0.921	2.113	0.921
2Y	0.965	0.50	0.959	1.044	1.157	1.950	0.942	2.230	0.942
3Y	1.000	0.30	0.995	1.069	1.139	1.947	0.022	2.315	0.022
4Y	1.157	0.00	1.156	1.278	1.293	2.037	1.070	2.502	1.070
5Y	1.220	-0.50	1.219	1.312	1.326	2.050	1.110	2.602	1.110
7Y	1.336	-0.60	1.337	1.434	1.443	2.140	1.163	2.728	1.163
10Y	1.462	-1.30	1.470	1.556	1.532	2.210	1.170	2.815	1.170
20Y	1.562	-0.50	1.562	1.644	1.581	2.170	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.10	0.00
CALL	0.74	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.61	0.01	111.61	111.64	111.53
LKTb	132.64	0.20	132.48	132.73	132.16

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	7.90	0.50	7.72	2.85	4.16	12.25	-7.50	12.25	-17.75
1.5Y	0.05	0.75	-1.35	-2.55	-0.43	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-3.25	0.00	-3.32	-6.48	-3.66	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-4.75	-0.80	-4.13	-6.66	-1.89	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-17.20	-0.50	-16.80	-23.48	-15.56	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-21.50	0.00	-21.03	-24.97	-18.19	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-32.85	-0.15	-32.48	-37.03	-29.85	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-41.20	0.05	-41.08	-45.08	-35.40	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-71.70	-0.75	-70.91	-79.52	-57.62	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1217.30 (-0.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-106.00	-2.00	1Y	-0.1250	-1.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	1.00	0.00		
-105.25	-1.75	1.5Y	-0.1200	-1.00	1.3150	1.1000	2*3Y	3.50	-1.00		
-104.75	-1.50	2Y	-0.1150	-1.00	1.2450	1.1000	2*5Y	3.00	-1.00		
-103.25	-1.50	3Y	-0.0800	-2.00	1.2400	-0.5650	3*4Y	0.00	0.50		
-106.50	-1.00	4Y	-0.0800	-1.50	1.2150	-0.4750	3*5Y	-0.50	0.00		
-109.00	-1.50	5Y	-0.0850	-2.00	1.2400	-0.4100	4*5Y	-0.50	-0.50		
-99.25	-1.25	7Y	0.0150	-2.00	1.3050	-0.3100	5*7Y	10.00	0.00		
-85.50	-0.75	10Y	0.1950	-2.00	1.4950	-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	0.2151	-0.0281	0.2432	0.2201	0.2201	2.8407	0.2101	2.9773	0.2101
10Y	0.7537	-0.0137	0.7674	0.7292	0.7292	3.0692	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	-74.99	-3.31	-71.68	-72.19	-73.19	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-70.83	-0.07	-70.76	-72.58	-71.48	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	11.75	-1.75	13.50	13.25	12.25	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	49.70	-1.80	51.50	51.30	49.20	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	53.86	1.44	52.42	50.91	50.91	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	93.25					SPRD	1.5*2y 0.25		
03Y									
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y CCS -13.5 3y CCS -8								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	40 건	14	26	48	72	78	123	73	
금 액	11,222 억원	667	10,555	14,844	21,655	26,594	33,563	18,835	

장중동향
국고채 금리, 국고채 금리가 10년 구간 위주로 하락했지만, 대부분 구간에서 반등, 전반적인 채권시장 재료는 강세를 나타냈지만 좀처럼 매수 심리가 회복하지 못한 가운데 수급에 따라 구간별 금리 방향이 엇갈림.

IRS, 금리 스와프는 보험권에서 혼조세를 보임. 2년 이하 금리는 다소 올랐지만 3년 이상부터는 소폭 하락.

CRS, 전 구간 하락. 마감