

IPS Daily Morning Brief

2020-04-17

종가 기준일 2020-04-16

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0100	-0.75	1.0075	1.0168	1.2062	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9625	-1.00	0.9600	0.9841	1.1679	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9250	-1.00	0.9210	0.9588	1.1377	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9175	-1.50	0.9195	0.9671	1.1239	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9125	-2.00	0.9210	0.9774	1.1117	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	0.9275	-2.50	0.9450	0.9996	1.1121	1.9375	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	0.9500	-3.50	0.9755	1.0386	1.1292	1.9500	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	0.9550	-5.00	0.9920	1.0561	1.1362	1.9600	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	0.9550	-5.25	0.9945	1.0571	1.1362	1.9875	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	0.9900	-6.00	1.0380	1.0981	1.1698	2.0525	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	0.9825	-4.75	1.0205	1.0585	1.1555	2.0825	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9350	-4.50	0.9710	0.9965	1.1168	2.0875	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8000	-4.50	0.8360	0.8489	0.9950	2.0825	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-4.75	-0.25	-4.75	-3.26	-3.83	3.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.75	0.00	-3.90	-2.54	-3.03	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-1.25	-1.00	0.00	1.86	-2.60	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	1.50	-0.50	2.40	2.23	0.04	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	3.75	-1.50	5.45	6.13	1.75	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	4.25	-3.00	7.10	7.88	2.45	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.25	-1.00	3.05	3.90	1.70	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	2.75	-2.50	4.70	5.65	2.40	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	0.50	-1.50	1.65	1.75	0.70	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.00	-0.25	0.25	0.10	0.00	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	3.50	-1.00	4.60	4.20	3.36	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.50	-0.75	4.35	4.10	3.35	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-0.75	1.25	-1.75	-3.96	-1.42	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-5.50	1.50	-6.70	-10.16	-5.30	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-19.00	1.50	-20.20	-24.93	-17.47	3.50	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.866	1.00	0.848	0.929	1.096	1.918	0.828	1.935	0.828
1.5Y	0.930	-0.20	0.930	0.991	1.128	1.938	0.921	2.113	0.921
2Y	0.962	-0.30	0.956	1.041	1.149	1.950	0.942	2.230	0.942
3Y	0.990	-1.00	0.990	1.066	1.131	1.947	0.022	2.315	0.022
4Y	1.132	-2.50	1.145	1.273	1.286	2.037	1.070	2.502	1.070
5Y	1.192	-2.80	1.206	1.309	1.320	2.050	1.110	2.602	1.110
7Y	1.301	-3.50	1.322	1.430	1.436	2.140	1.163	2.728	1.163
10Y	1.420	-4.20	1.451	1.552	1.526	2.210	1.170	2.815	1.170
20Y	1.547	-1.50	1.552	1.643	1.578	2.167	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	111.67	0.06	111.66	111.75	111.62
LKTB	133.14	0.50	132.90	133.43	132.81

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	5.90	-2.00	7.32	3.02	4.17	12.25	-7.50	12.25	-17.75
1.5Y	-1.25	-1.30	-1.03	-2.43	-0.45	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-4.95	-1.70	-3.52	-6.39	-3.68	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-6.25	-1.50	-4.48	-6.61	-1.93	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-18.20	-1.00	-16.93	-23.44	-15.69	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-23.70	-2.20	-21.42	-25.28	-18.36	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-34.60	-1.75	-32.73	-37.25	-30.03	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-43.00	-1.80	-41.32	-45.36	-35.65	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-74.70	-3.00	-71.56	-79.45	-58.26	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1228.70 (+11.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-122.00	-16.00	1Y	-0.2950	-17.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	5.50	4.50		
-118.25	-13.00	1.5Y	-0.2650	-14.50	1.3150	1.1000	2*3Y	3.50	0.00		
-115.25	-10.50	2Y	-0.2400	-12.50	1.2450	1.1000	2*5Y	3.50	0.50		
-113.25	-10.00	3Y	-0.2050	-12.50	1.2400	-0.5650	3*4Y	0.00	0.00		
-115.50	-9.00	4Y	-0.2050	-12.50	1.2150	-0.4750	3*5Y	0.00	0.50		
-116.00	-7.00	5Y	-0.2050	-12.00	1.2150	-0.4100	4*5Y	0.00	0.50		
-106.00	-6.75	7Y	-0.1050	-12.00	1.2800	-0.3100	5*7Y	10.00	0.00		
-91.50	-6.00	10Y	0.0750	-12.00	1.4700	-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	0.2186	0.0035	0.2151	0.2432	0.2201	2.8407	0.2101	2.9773	0.2101
10Y	0.6236	-0.1301	0.7537	0.7674	0.7292	3.0637	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	-74.34	0.65	-74.99	-71.68	-72.19	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-79.64	-8.81	-70.83	-70.76	-72.58	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	7.75	-4.00	11.75	13.50	13.25	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	45.80	-3.90	49.70	51.50	51.30	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	40.50	-13.36	53.86	52.42	50.91	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	96.5								
01Y	92								
1.5Y									
02Y		SPRD	3*4y 2.72						
03Y	92.5 / 93.25 / 92								
04Y	96								
05Y	96 / 97.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	78 건	38	40	26	48	72	78	123	
금 액	27,060 억원	15,838	11,222	10,555	14,844	21,655	26,594	33,563	

장중동향
국고채 금리, 서울 채권시장은 전일 미 금리 하락 등의 영향으로 금리가 하락 출발한 가운데 외국인의 국채선물 매수세가 더해지면서 강세로 장을 마친. 전 구간 국고채 금리 하락.

IRS. 전 구간 하락. 단기보다 장기 금리가 더 내려 수익률 곡선은 평탄해지며 커브 플레이트닝.

CRS. 전 구간 하락. 마감