IPS Daily Morning Brief

2020-04-20

종가 기준일 2020-04-17

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0100	0.00	1.0100	1.0164	1.1993	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9675	0.50	0.9635	0.9815	1.1606	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9325	0.75	0.9255	0.9541	1.1299	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9300	1.25	0.9225	0.9609	1.1162	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9300	1.75	0.9225	0.9694	1.1042	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	0.9450	1.75	0.9440	0.9904	1.1047	1.9375	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	0.9650	1.50	0.9720	1.0276	1.1218	1.9500	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	0.9750	2.00	0.9870	1.0436	1.1289	1.9600	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	0.9750	2.00	0.9895	1.0450	1.1288	1.9875	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.0175	2.75	1.0325	1.0865	1.1626	2.0525	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.0125	3.00	1.0180	1.0499	1.1480	2.0825	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9650	3.00	0.9690	0.9903	1.1088	2.0875	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8275	2.75	0.8335	0.8448	0.9860	2.0825	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-4.25	0.50	-4.65	-3.49	-3.88	3.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.50	0.25	-3.80	-2.74	-3.07	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-0.25	1.00	-0.30	1.53	-2.57	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	1.50	0.00	2.15	2.10	0.05	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	3.50	-0.25	4.95	5.83	1.77	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	4.50	0.25	6.45	7.43	2.48	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.00	-0.25	2.80	3.73	1.71	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	3.00	0.25	4.30	5.33	2.42	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.00	0.50	1.50	1.60	0.71	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.00	0.00	0.25	0.14	-0.01	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	4.25	0.75	4.55	4.29	3.37	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.25	0.75	4.30	4.15	3.38	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-0.50	0.25	-1.45	-3.66	-1.45	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-5.25	0.25	-6.35	-9.63	-5.38	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-19.00	0.00	-19.90	-24.18	-17.66	3.50	-35.00	11.25	-35.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.871	0.50	0.856	0.924	1.088	1.918	0.828	1.935	0.828
1.5Y	0.934	0.40	0.930	0.988	1.121	1.938	0.921	2.113	0.921
2Y	0.980	1.80	0.962	1.033	1.142	1.950	0.942	2.230	0.942
3Y	1.010	2.00	0.993	1.056	1.125	1.947	0.022	2.315	0.022
4Y	1.155	2.30	1.146	1.259	1.281	2.037	1.070	2.502	1.070
5Y	1.220	2.80	1.210	1.297	1.315	2.050	1.110	2.602	1.110
7Y	1.330	2.90	1.325	1.417	1.432	2.140	1.163	2.728	1.163
10Y	1.448	2.80	1.452	1.541	1.522	2.210	1.170	2.815	1.170
20Y	1.567	2.00	1.556	1.637	1.575	2.167	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	111.59	-0.08	111.63	111.65	111.58
LKTB	132.76	-0.38	132.93	133.06	132.66

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	6.15	0.25	6.91	2.98	4.18	12.25	-7.50	12.25	-17.75
1.5Y	-0.40	0.85	-0.73	-2.68	-0.47	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-5.00	-0.05	-3.93	-6.33	-3.74	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-6.50	-0.25	-4.94	-6.59	-2.03	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-19.00	-0.80	-17.44	-23.10	-15.89	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-24.50	-0.80	-22.28	-25.35	-18.59	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-35.50	-0.90	-33.53	-37.24	-30.27	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-43.05	-0.05	-41.95	-45.42	-35.96	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-73.95	0.75	-72.25	-79.25	-58.92	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-117.75	4.25
-113.00	5.25
-109.00	6.25
-106.50	6.75
-108.50	7.00
-109.00	7.00
-99.00	7.00
-85.25	6.25

CRS

USD/KRW 1217.90 (-10.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-0.2450	5.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	8.50	3.00
1.5Y	-0.2000	6.50	1.3150	1.1000	2*3Y	4.00	0.50
2Y	-0.1600	8.00	1.2450	1.1000	2*5Y	4.50	1.00
3Y	-0.1200	8.50	1.2400	-0.5650	3*4Y	0.00	0.00
4Y	-0.1200	8.50	1.2150	-0.4750	3*5Y	0.50	0.50
5Y	-0.1150	9.00	1.2100	-0.4100	4*5Y	0.50	0.50
7Y	-0.0150	9.00	1.2700	-0.3100	5*7Y	10.00	0.00
10Y	0.1650	9.00	1.4600	-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	0.2019	-0.0167	0.2186	0.2151	0.2432	2.8407	0.2019	2.9773	0.2019
10Y	0.6434	0.0198	0.6236	0.7537	0.7674	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	-77.81	-3.47	-74.34	-74.99	-71.68	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-80.46	-0.82	-79.64	-70.83	-70.76	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	8.75	1.00	7.75	11.75	13.50	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	46.80	1.00	45.80	49.70	51.50	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	44.15	3.65	40.50	53.86	52.42	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	93	SPRD	6*12m -8.75
03Y			9*12m -4
04Y			
05Y	97.5 / 97		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1.5y CCR -19 2y CCR -23		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	78 건	0	78	40	26	48	72	78
금 액	17,420 억원	-9,640	27,060	11,222	10,555	14,844	21,655	26,594

장중동향

국고채 금리. 이날 코스피가 급등세를 지속하는 등 위험자산 선호 분위기가 금리 상승 재료로 작용하며 국고채 금리 상승. 정부가 신종 코로나19에 대응하기 위한 확대 재정정책 기조를 보인 가운데 다음 주 국고 20년물 입찰을 앞둔 물량 부담도 약세요인으로 꼽힘.

IRS. 거래가 많지는 않았으나 전반적으로 국채선물 약세에 연동한 모습을 보이며 전구간 상승. 10년과 20년구간에서는 그동안의 강세를 되돌리는 움직임을 나타냄.

CRS. 전 구간 상승. 마감