

IPS Daily Morning Brief

2020-04-21

종가 기준일 2020-04-20

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0075	-0.25	1.0115	1.0180	1.1922	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9650	-0.25	0.9665	0.9813	1.1529	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9300	-0.25	0.9295	0.9521	1.1217	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9275	-0.25	0.9265	0.9578	1.1080	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9250	-0.50	0.9255	0.9643	1.0959	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	0.9400	-0.50	0.9445	0.9845	1.0965	1.9375	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	0.9600	-0.50	0.9700	1.0198	1.1137	1.9500	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	0.9700	-0.50	0.9830	1.0345	1.1209	1.9600	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	0.9700	-0.50	0.9845	1.0359	1.1206	1.9875	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.0075	-1.00	1.0255	1.0773	1.1545	2.0500	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.0100	-0.25	1.0155	1.0438	1.1398	2.0800	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9625	-0.25	0.9670	0.9860	1.1000	2.0850	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8175	-1.00	0.8295	0.8420	0.9760	2.0800	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-4.25	0.00	-4.50	-3.68	-3.93	3.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.50	0.00	-3.70	-2.91	-3.12	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-0.50	-0.25	-0.40	1.21	-2.58	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	1.50	0.00	1.90	2.03	0.06	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	3.50	0.00	4.45	5.55	1.78	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	4.50	0.00	5.75	7.03	2.50	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.00	0.00	2.55	3.53	1.72	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	3.00	0.00	3.85	5.00	2.44	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.00	0.00	1.30	1.48	0.72	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.00	0.00	0.15	0.14	-0.02	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	3.75	-0.50	4.25	4.28	3.36	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.75	-0.50	4.10	4.14	3.39	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	0.25	0.75	-1.00	-3.35	-1.47	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-4.50	0.75	-5.85	-9.13	-5.45	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-19.00	0.00	-19.60	-23.53	-17.85	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	-0.50	0.862	0.920	1.080	1.918	0.828	1.935	0.828
1.5Y	0.933	-0.10	0.932	0.985	1.113	1.934	0.921	2.113	0.921
2Y	0.981	0.10	0.970	1.026	1.134	1.947	0.942	2.230	0.942
3Y	1.015	0.50	1.002	1.051	1.118	1.935	0.022	2.315	0.022
4Y	1.153	-0.20	1.151	1.246	1.275	2.025	1.070	2.502	1.070
5Y	1.217	-0.30	1.215	1.288	1.309	2.040	1.110	2.602	1.110
7Y	1.326	-0.40	1.327	1.407	1.426	2.133	1.163	2.728	1.163
10Y	1.442	-0.60	1.449	1.531	1.517	2.205	1.170	2.815	1.170
20Y	1.560	-0.70	1.561	1.631	1.572	2.165	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.10	0.00
CALL	0.75	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.61	0.02	111.58	111.67	111.58
LKTb	132.89	0.13	132.65	133.17	132.65

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	6.40	0.25	6.75	3.17	4.15	12.25	-7.50	12.25	-17.75
1.5Y	-0.55	-0.15	-0.57	-2.73	-0.51	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-5.60	-0.60	-4.41	-6.19	-3.84	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-7.50	-1.00	-5.79	-6.63	-2.15	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-19.30	-0.30	-18.08	-22.59	-16.11	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-24.70	-0.20	-23.18	-25.33	-18.84	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-35.60	-0.10	-34.25	-37.11	-30.53	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-43.45	-0.40	-42.39	-45.40	-36.29	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-74.25	-0.30	-73.11	-78.85	-59.62	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1220.50 (+2.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-118.50	-0.75	1Y	-0.2550	-1.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	13.50	5.00		
-111.25	1.75	1.5Y	-0.1850	1.50	1.3150	1.1000	2*3Y	4.00	0.00		
-104.50	4.50	2Y	-0.1200	4.00	1.2450	1.1000	2*5Y	4.50	0.00		
-102.00	4.50	3Y	-0.0800	4.00	1.2400	-0.5650	3*4Y	0.00	0.00		
-104.00	4.50	4Y	-0.0800	4.00	1.2150	-0.4750	3*5Y	0.50	0.00		
-104.50	4.50	5Y	-0.0750	4.00	1.2100	-0.4100	4*5Y	0.50	0.00		
-94.50	4.50	7Y	0.0250	4.00	1.2700	-0.3100	5*7Y	10.00	0.00		
-80.25	5.00	10Y	0.2050	4.00	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	0.2137	0.0118	0.2019	0.2186	0.2151	2.8407	0.2019	2.9773	0.2019
10Y	0.6077	-0.0357	0.6434	0.6236	0.7537	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	-76.73	1.08	-77.81	-74.34	-74.99	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-83.43	-2.97	-80.46	-79.64	-70.83	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	8.25	-0.50	8.75	7.75	11.75	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	46.10	-0.70	46.80	45.80	49.70	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	39.40	-4.75	44.15	40.50	53.86	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	96.5								
01Y									
1.5Y									
02Y		SPRD							
03Y									
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y CCR -08								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	36 건	-42	78	78	40	26	48	72	
금 액	9,913 억원	-7,507	17,420	27,060	11,222	10,555	14,844	21,655	

장중동향
국고채 금리, 외국인이 채권 현물과 선물을 순매수하면서 장중 강세가 나타났지만, 장 막판에 입찰 옵션 행사를 염두에 둔 것으로 추정되는 매도 물량이 나오면서 국고채 금리 상승 마감.

IRS. 거래가 거의 없었고 한산한 하루였으며 국채의 소폭 강세에 연동해 IRS금리도 전 구간 하락.

CRS. 1년을 제외하고 상승. 마감