

IPS Daily Morning Brief

2020-04-23

종가 기준일 2020-04-22

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0100	0.50	1.0085	1.0163	1.1780	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9675	0.50	0.9650	0.9769	1.1378	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9325	0.50	0.9295	0.9454	1.1055	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9375	1.00	0.9280	0.9499	1.0921	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9425	1.50	0.9275	0.9529	1.0804	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	0.9700	2.75	0.9450	0.9735	1.0815	1.9375	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	1.0050	4.50	0.9680	1.0058	1.0991	1.9500	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	1.0250	5.50	0.9790	1.0196	1.1066	1.9600	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	1.0325	6.25	0.9805	1.0209	1.1062	1.9875	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.0850	7.75	1.0215	1.0631	1.1407	2.0500	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.0875	7.75	1.0205	1.0356	1.1258	2.0800	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	1.0450	7.75	0.9750	0.9821	1.0850	2.0850	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.9000	7.75	0.8335	0.8404	0.9588	2.0750	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-4.25	0.00	-4.35	-3.94	-4.03	3.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.50	0.00	-3.55	-3.15	-3.22	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	1.00	1.00	-0.20	0.75	-2.52	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.75	1.25	1.75	2.06	0.12	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	6.25	3.00	4.05	5.29	1.88	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	8.25	4.00	5.15	6.68	2.63	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.50	1.75	2.30	3.23	1.76	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	5.50	2.75	3.40	4.61	2.51	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.00	1.00	1.10	1.39	0.75	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.75	0.75	0.15	0.13	-0.04	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	6.00	2.25	4.25	4.35	3.41	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.25	1.50	4.10	4.23	3.45	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	0.25	0.00	-0.10	-2.75	-1.50	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-4.00	0.00	-4.65	-8.10	-5.57	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-18.50	0.00	-18.80	-22.28	-18.19	3.50	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.858	-0.60	0.865	0.909	1.064	1.918	0.828	1.935	0.828
1.5Y	0.940	0.60	0.934	0.978	1.098	1.932	0.921	2.113	0.921
2Y	1.007	1.00	0.985	1.012	1.121	1.944	0.942	2.230	0.942
3Y	1.042	0.70	1.018	1.040	1.105	1.917	0.022	2.315	0.022
4Y	1.197	3.20	1.160	1.219	1.264	2.002	1.070	2.502	1.070
5Y	1.275	4.30	1.227	1.267	1.300	2.010	1.110	2.602	1.110
7Y	1.400	5.80	1.340	1.384	1.417	2.099	1.163	2.728	1.163
10Y	1.540	8.50	1.461	1.508	1.511	2.170	1.170	2.815	1.170
20Y	1.635	6.00	1.577	1.611	1.568	2.122	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	111.46	-0.10	111.58	111.60	111.43
LKTb	131.70	-1.05	132.86	133.03	131.69

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	7.45	1.10	6.45	3.61	4.13	12.25	-6.50	12.25	-17.75
1.5Y	-0.25	0.40	-0.62	-2.83	-0.60	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-6.45	0.50	-5.79	-5.87	-4.03	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-7.20	2.05	-7.34	-6.62	-2.36	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-19.20	1.30	-19.24	-21.34	-16.51	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-25.00	1.20	-24.82	-24.77	-19.31	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-36.75	0.45	-35.93	-36.32	-31.08	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-45.50	-0.75	-43.95	-44.49	-37.00	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-73.50	1.75	-74.33	-77.06	-60.93	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1232.20 (+2.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-153.25	-25.50	1Y	-0.6000	-25.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	27.00	13.00		
-139.75	-19.50	1.5Y	-0.4600	-18.50	1.3150	1.1000	2*3Y	5.50	0.50		
-127.25	-13.50	2Y	-0.3300	-12.00	1.2450	1.1000	2*5Y	10.00	3.00		
-124.50	-14.25	3Y	-0.2750	-11.50	1.2400	-0.5650	3*4Y	2.50	1.50		
-125.50	-14.50	4Y	-0.2500	-10.00	1.2150	-0.4750	3*5Y	4.50	2.50		
-125.50	-14.50	5Y	-0.2300	-9.00	1.2100	-0.4100	4*5Y	2.00	1.00		
-116.25	-15.25	7Y	-0.1300	-9.00	1.2700	-0.3100	5*7Y	10.00	0.00		
-103.50	-16.75	10Y	0.0500	-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	0.2173	0.0119	0.2054	0.2137	0.2019	2.8407	0.2019	2.9773	0.2019
10Y	0.6262	0.0563	0.5699	0.6077	0.6434	3.0617	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	-78.97	0.19	-79.16	-76.73	-77.81	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-91.38	-2.87	-88.51	-83.43	-80.46	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	14.25	6.25	8.00	8.25	8.75	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	53.30	7.50	45.80	46.10	46.80	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	40.89	4.44	36.45	39.40	44.15	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M	75								
09M									
01Y									
1.5Y	94.5								
02Y	93.5				SPRD	5*10y 3.75			
03Y									
04Y	96.25								
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1y crs -5.5 2y crs -34 5y crs 25								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	62 건	-1	63	36	78	78	40	26	
금 액	14,737 억원	-4,384	19,121	9,913	17,420	27,060	11,222	10,555	

장중동향
국고채 금리, 정부가 3차 추가경정예산을 공식화하고 재원 대부분을 적자국채 발행을 통해 충당하기로 하면서 장기를 중심으로 약세가 심화하며 국고채 금리 급등.

IRS, 장 후반 국채 현물 금리 급등에 따라 IRS 금리도 전 구간 상승하며 최근 스와프 시장은 불확실성이 커 거래 자체가 줄고 한산한 분위기.

CRS, 전 구간 급락, 마감