

IPS Daily Morning Brief

2020-04-24

종가 기준일 2020-04-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.0025	-0.75	1.0070	1.0124	1.1713	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9625	-0.50	0.9650	0.9723	1.1308	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9275	-0.50	0.9300	0.9400	1.0983	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9275	-1.00	0.9300	0.9450	1.0851	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9325	-1.00	0.9315	0.9488	1.0739	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	0.9575	-1.25	0.9510	0.9711	1.0757	1.9375	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	0.9925	-1.25	0.9765	1.0035	1.0938	1.9500	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	1.0175	-0.75	0.9915	1.0180	1.1018	1.9600	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	1.0200	-1.25	0.9935	1.0194	1.1015	1.9875	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.0650	-2.00	1.0365	1.0621	1.1362	2.0500	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.0675	-2.00	1.0375	1.0373	1.1212	2.0800	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	1.0250	-2.00	0.9930	0.9859	1.0801	2.0850	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8800	-2.00	0.8495	0.8441	0.9528	2.0750	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-4.00	0.25	-4.20	-4.01	-4.05	3.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.50	0.00	-3.50	-3.23	-3.25	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	0.50	-0.50	0.15	0.87	-2.45	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.50	-0.25	1.95	2.24	0.18	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	6.00	-0.25	4.50	5.48	2.00	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	8.50	0.25	6.00	6.93	2.79	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.50	0.00	2.55	3.24	1.81	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	6.00	0.50	4.05	4.69	2.61	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.50	0.50	1.50	1.45	0.80	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.25	-0.50	0.20	0.14	-0.03	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	4.75	-1.25	4.50	4.41	3.44	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.50	-0.75	4.30	4.28	3.48	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	0.25	0.00	0.10	-2.49	-1.50	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-4.00	0.00	-4.35	-7.63	-5.61	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-18.50	0.00	-18.70	-21.80	-18.35	3.50	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.829	-2.90	0.858	0.901	1.056	1.918	0.828	1.935	0.828
1.5Y	0.927	-1.30	0.934	0.974	1.091	1.932	0.921	2.113	0.921
2Y	0.990	-1.70	0.991	1.006	1.115	1.944	0.942	2.230	0.942
3Y	1.027	-1.50	1.026	1.036	1.100	1.917	0.022	2.315	0.022
4Y	1.207	1.00	1.175	1.211	1.261	2.002	1.070	2.502	1.070
5Y	1.292	1.70	1.247	1.263	1.298	2.002	1.110	2.602	1.110
7Y	1.412	1.20	1.362	1.380	1.415	2.086	1.163	2.728	1.163
10Y	1.548	0.80	1.487	1.504	1.510	2.152	1.170	2.815	1.170
20Y	1.635	0.00	1.594	1.606	1.569	2.116	0.705	2.792	0.705

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.48	0.02	111.46	111.55	111.45
LKTb	131.66	-0.04	131.60	132.15	131.51

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	9.85	2.40	7.24	3.90	4.19	12.25	-6.10	12.25	-17.75
1.5Y	0.05	0.30	-0.36	-2.88	-0.61	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-5.75	0.70	-5.95	-5.74	-4.11	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-6.95	0.25	-7.48	-6.48	-2.45	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-21.45	-2.25	-19.89	-20.79	-16.72	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-27.45	-2.45	-25.57	-24.48	-19.57	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-39.20	-2.45	-36.85	-36.03	-31.38	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-48.30	-2.80	-45.01	-44.23	-37.40	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-75.50	-2.00	-74.49	-76.19	-61.58	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1229.70 (-2.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-142.25	11.00	1Y	-0.4950	10.50	1.3900	-1.4500	1*2Y	17.50	-9.50		
-133.25	6.50	1.5Y	-0.4050	5.50	1.3150	1.1000	2*3Y	6.00	0.50		
-125.25	2.00	2Y	-0.3200	1.00	1.2450	1.1000	2*5Y	11.00	1.00		
-121.75	2.75	3Y	-0.2600	1.50	1.2400	-0.5650	3*4Y	3.00	0.50		
-122.25	3.25	4Y	-0.2300	2.00	1.2150	-0.4750	3*5Y	5.00	0.50		
-122.75	2.75	5Y	-0.2100	2.00	1.2100	-0.4100	4*5Y	2.00	0.00		
-113.00	3.25	7Y	-0.1100	2.00	1.2700	-0.3100	5*7Y	10.00	0.00		
-99.50	4.00	10Y	0.0700	2.00	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	0.2332	0.0159	0.2173	0.2054	0.2137	2.8307	0.2019	2.9773	0.2019
10Y	0.6086	-0.0176	0.6262	0.5699	0.6077	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	-75.68	3.29	-78.97	-79.16	-76.73	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-93.94	-2.56	-91.38	-88.51	-83.43	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	13.25	-1.00	14.25	8.00	8.25	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	55.80	2.50	53.30	45.80	46.10	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	37.54	-3.35	40.89	36.45	39.40	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	92.5								
1.5Y									
02Y	93	SPRD	6*8y 0.5						
03Y	96		4*7y 2.25						
04Y	99.5								
05Y									
07Y									
10Y	5.5								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	55 건	-7	62	63	36	78	78	40	
금 액	13,817 억원	-920	14,737	19,121	9,913	17,420	27,060	11,222	

장중동향
 국고채 금리. 전일 정부가 내놓은 대규모 정책패키지와 함께 국채 발행량 증가 이슈가 장기를 중심으로 상승 부담으로 이어지며 국고채 금리 엇갈림. 특히 5년 금리는 기간산업안정기금 채권이 5년 만기가 발행될 수 있다는 우려에 장중 나홀로 반등하는 등 약세 압력이 두드러짐.

IRS. 거래가 거의 없었으며 결과적으로 플랫이 나왔지만 장기 오퍼가 강해진 없음. 국채 발행 계획 등을 대기하는 분위기로 전 구간 소폭 하락 .

CRS. 전 구간 상승. 마감