

IPS Daily Morning Brief

2020-05-04

종가 기준일 2020-04-29

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9725	-1.50	0.9865	1.0034	1.1455	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9350	-1.25	0.9470	0.9618	1.1040	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9050	-1.125	0.9150	0.9280	1.0705	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9000	-1.75	0.9125	0.9325	1.0580	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9000	-1.75	0.9125	0.9374	1.0480	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	0.9225	-2.25	0.9405	0.9641	1.0525	1.9375	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	0.9500	-2.75	0.9740	0.9983	1.0727	1.9500	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	0.9750	-3.00	1.0010	1.0179	1.0825	1.9600	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	0.9875	-3.00	1.0085	1.0219	1.0828	1.9875	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.0375	-3.00	1.0560	1.0671	1.1191	2.0500	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.0400	-3.00	1.0585	1.0518	1.1035	2.0800	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	1.0000	-3.00	1.0180	1.0046	1.0609	2.0850	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8575	-3.00	0.8750	0.8644	0.9295	2.0750	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-3.75	0.25	-3.95	-4.16	-4.15	0.75	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.00	0.00	-3.20	-3.38	-3.35	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-0.50	-0.50	-0.25	0.94	-2.26	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.25	-0.50	2.80	2.68	0.46	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	5.00	-1.00	6.15	6.09	2.47	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.50	-1.25	8.85	8.05	3.45	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.75	-0.50	3.35	3.41	2.01	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	5.25	-0.75	6.05	5.38	2.99	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.50	-0.25	2.70	1.96	0.98	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	1.25	0.00	0.75	0.40	0.04	2.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	6.25	0.00	5.50	4.93	3.67	9.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	0.00	4.75	4.53	3.63	6.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	0.25	0.00	0.25	-1.54	-1.57	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-3.75	0.00	-3.80	-6.25	-5.83	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-18.00	0.00	-18.10	-20.28	-18.97	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.793	-0.40	0.802	0.858	1.025	1.918	0.793	1.935	0.793
1.5Y	0.875	-1.30	0.898	0.947	1.064	1.932	0.875	2.113	0.875
2Y	0.955	-1.50	0.968	0.985	1.093	1.944	0.942	2.230	0.942
3Y	1.010	-2.00	1.020	1.024	1.081	1.917	0.022	2.315	0.022
4Y	1.164	-3.60	1.191	1.192	1.248	1.995	1.070	2.502	1.070
5Y	1.247	-3.80	1.274	1.258	1.289	1.992	1.110	2.602	1.110
7Y	1.376	-3.60	1.404	1.376	1.408	2.066	1.163	2.728	1.163
10Y	1.517	-3.50	1.547	1.506	1.508	2.127	1.170	2.815	1.170
20Y	1.625	-5.20	1.649	1.608	1.571	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.10	0.00
CALL	0.75	3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.64	0.13	111.55	111.66	111.54
LKTb	132.04	0.43	131.72	132.10	131.70

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	11.20	-0.85	11.34	6.97	4.55	12.25	-5.30	12.25	-17.75
1.5Y	2.50	-0.45	1.49	-1.46	-0.60	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-5.50	-0.25	-5.59	-4.73	-4.46	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-8.75	-0.25	-7.95	-5.97	-2.82	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-21.40	0.85	-21.68	-19.37	-17.53	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-27.20	0.80	-27.30	-24.01	-20.63	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-38.85	0.60	-39.51	-35.43	-32.52	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-47.95	0.50	-49.06	-43.85	-38.91	-7.70	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-76.75	2.20	-77.38	-74.40	-64.20	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1218.20 (-7.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-129.00	8.75	1Y	-0.3850	7.50	1.3900	-1.4500	1*2Y	0.50	-7.50		
-129.50	5.25	1.5Y	-0.3950	3.50	1.3150	1.1000	2*3Y	4.00	-0.50		
-128.00	1.75	2Y	-0.3800	0.00	1.2450	1.1000	2*5Y	9.00	-1.50		
-126.25	1.75	3Y	-0.3400	-0.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	2.50	-0.75		
-126.50	1.50	4Y	-0.3150	-1.25	1.2000	-0.4750	3*5Y	5.00	-1.00		
-126.50	1.50	5Y	-0.2900	-1.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	2.50	-0.25		
-115.75	1.50	7Y	-0.1700	-1.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-102.75	1.50	10Y	0.0100	-1.50	1.4300	-0.1250	5*10Y	30.00	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	0.2033	-0.0312	0.2345	0.2121	0.2245	2.8272	0.2019	2.9773	0.2019
10Y	0.6285	0.0116	0.6169	0.6637	0.6056	2.9733	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	-75.17	-1.62	-73.55	-75.49	-73.55	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-88.85	4.66	-93.51	-91.73	-92.94	90.75	-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	13.75	-1.25	15.00	15.75	14.00	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	56.20	-2.00	58.20	61.40	57.50	61.40	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	42.52	4.28	38.24	45.16	38.11	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	89.75 / 89.5	SPRD	2*3y 2.25						
03Y	92.75 / 91.75		8*9y 2.25						
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2*4y crs 7								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	100 건	44	56	74	75	55	62	63	
금 액	43,787 억원	25,382	18,405	23,085	19,066	13,817	14,737	19,121	

장중동향
국고채 금리, 전 구간 하락. 서울채권시장은 전일 한국은행이 공개한 4월 금융위 의사록이 비둘기파적으로 해석됐고 외국인의 국채선물 순매수세에 힘입어 강세로 출발. 장중에는 한은의 기간산업안정기금 채권 매입 기대가 돌면서 한은이 직매입 여부에 결정된 바 없으며 한발 물러선 입장을 보였지만 원도드레싱성 매수가 더해지면서 강세 분위기 지속.

IRS, 국채 현물에 연동해 IRS금리가 하락했으며 최근 금리 상승폭이 상대적으로 작아 이날 낙폭도 현물보다는 제한적.

CRS, FX스와프가 오른 영향에 1년 구간이 상승하고 나머지 구간 하락. 마감