

IPS Daily Morning Brief

2020-05-07

종가 기준일 2020-05-06

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9400	-1.25	0.9680	0.9949	1.1315	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9025	-1.25	0.9295	0.9525	1.0894	1.9025	0.9025	1.9125	0.9025
1Y	0.8725	-1.25	0.8990	0.9183	1.0555	1.9100	0.8725	1.9200	0.8725
1.5Y	0.8600	-1.25	0.8925	0.9200	1.0431	1.9100	0.8600	2.0250	0.8600
2Y	0.8550	-1.25	0.8905	0.9235	1.0335	1.8975	0.8550	2.1150	0.8550
3Y	0.8750	-1.25	0.9150	0.9491	1.0390	1.8900	0.8750	2.2225	0.8750
4Y	0.9050	-1.00	0.9460	0.9829	1.0597	1.8850	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	0.9250	-1.00	0.9710	1.0033	1.0699	1.8800	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	0.9425	-0.50	0.9830	1.0089	1.0706	1.8825	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	0.9925	-0.50	1.0330	1.0554	1.1075	1.9300	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	0.9950	-0.50	1.0355	1.0446	1.0915	1.9550	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9550	-0.50	0.9955	0.9989	1.0481	1.9575	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8125	-0.50	0.8530	0.8584	0.9147	1.9475	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-3.75	0.00	-3.85	-4.24	-4.20	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.00	0.00	-3.05	-3.43	-3.39	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-1.75	0.00	-0.85	0.52	-2.20	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.00	0.00	2.45	2.56	0.54	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	5.00	0.25	5.55	5.94	2.61	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.00	0.25	8.05	7.98	3.63	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.00	0.25	3.10	3.38	2.07	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	5.00	0.25	5.60	5.41	3.09	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.00	0.00	2.50	2.04	1.02	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	1.75	0.50	1.20	0.56	0.07	1.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	6.75	0.50	6.20	5.21	3.76	7.75	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	0.00	5.00	4.65	3.69	6.00	1.50	12.75	1.50
10*12Y	0.25	0.00	0.25	-1.08	-1.60	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-3.75	0.00	-3.75	-5.65	-5.94	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-18.00	0.00	-18.00	-19.70	-19.28	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.775	-1.60	0.790	0.839	1.009	1.918	0.775	1.935	0.775
1.5Y	0.846	-1.00	0.873	0.927	1.049	1.932	0.846	2.113	0.846
2Y	0.915	-0.20	0.945	0.972	1.080	1.944	0.915	2.230	0.915
3Y	0.957	-1.50	0.999	1.013	1.069	1.890	0.022	2.315	0.022
4Y	1.137	0.70	1.167	1.177	1.240	1.932	1.070	2.502	1.070
5Y	1.230	1.70	1.253	1.249	1.282	1.925	1.110	2.602	1.110
7Y	1.364	1.60	1.386	1.369	1.402	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.515	1.90	1.532	1.502	1.505	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.637	1.50	1.648	1.607	1.571	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.10	0.00
CALL	0.72	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.78	0.03	111.73	111.79	111.72
LKTb	132.20	-0.09	132.12	132.34	132.10

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	9.75	0.35	10.90	7.93	4.63	12.25	-5.30	12.25	-17.75
1.5Y	1.40	-0.25	1.97	-0.70	-0.62	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-6.00	-1.05	-5.43	-4.83	-4.69	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-8.20	0.25	-8.40	-6.38	-3.04	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-23.20	-1.70	-22.08	-19.45	-18.00	-4.70	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-30.50	-2.70	-28.22	-24.53	-21.25	-4.50	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-42.15	-2.10	-40.28	-36.04	-33.16	-10.30	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-52.25	-2.40	-49.92	-44.71	-39.73	-10.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-82.45	-2.00	-79.46	-74.83	-65.68	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1222.10 (-7.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-119.75	5.25	1Y	-0.3250	4.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	1.50	1.00		
-118.00	5.75	1.5Y	-0.3200	4.50	1.3150	1.1000	2*3Y	0.75	-0.25		
-116.50	6.25	2Y	-0.3100	5.00	1.2450	1.1000	2*5Y	6.00	0.50		
-117.75	6.00	3Y	-0.3025	4.75	1.2150	-0.5650	3*4Y	2.25	0.25		
-118.50	6.00	4Y	-0.2800	5.00	1.2000	-0.4750	3*5Y	5.25	0.75		
-117.50	6.50	5Y	-0.2500	5.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	3.00	0.50		
-106.75	6.50	7Y	-0.1250	6.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.50	0.50		
-93.75	6.50	10Y	0.0550	6.00	1.4150	-0.1250	5*10Y	30.50	0.50		

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	0.1843	-0.0038	0.1881	0.2033	0.2345	2.8272	0.1843	2.9773	0.1843
10Y	0.7054	0.0646	0.6408	0.6285	0.6169	2.9145	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	-73.07	-0.18	-72.89	-75.17	-73.55	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-80.96	4.56	-85.52	-88.85	-93.51	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	0.75	13.00	13.75	15.00	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	60.00	2.10	57.90	56.20	58.20	61.40	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	52.11	6.84	45.27	42.52	38.24	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS									
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	87								1*1.5y -01
03Y									10*20y -18
04Y									
05Y	93.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	78 건	-23	101	100	56	74	75	55	
금 액	38,098 억원	-9,022	47,120	43,787	18,405	23,085	19,066	13,817	

장중동향
국고채 금리, 단기물 금리는 하락했지만 5년 이상 구간에서는 상승하며 국고채 금리가 엇갈림. 외국인인 3년과 10년 국채선물을 모두 순매수했지만, 장기 구간에서는 수급 부담에 따른 약세 압력이 강해 수익률곡선은 가팔라짐. 커브스티프닝.

IRS. 전 구간 하락. 단기구간을 중심으로 매매가 이루어졌고 거래량이 적어 금리 변동에 큰 의미는 없음. 장기금리는 단기구간 위주의 거래를 스크린 상에서만 반영한 측면이 있음.

CRS. 전 구간 상승. 마감