IPS Daily Morning Brief

2020-05-11

종가 기준일 2020-05-08

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9175	-0.75	0.9415	0.9863	1.1173	1.9125	0.9175	1.9125	0.9175
9M	0.8600	-1.50	0.8975	0.9419	1.0744	1.8950	0.8600	1.9125	0.8600
1Y	0.8200	-1.75	0.8640	0.9066	1.0400	1.8800	0.8200	1.9200	0.8200
1.5Y	0.8075	-2.00	0.8535	0.9050	1.0278	1.8700	0.8075	2.0250	0.8075
2Y	0.7950	-2.50	0.8475	0.9060	1.0184	1.8500	0.7950	2.1150	0.7950
3Y	0.8175	-3.00	0.8700	0.9308	1.0246	1.8175	0.8175	2.2225	0.8175
4Y	0.8425	-3.25	0.8975	0.9620	1.0460	1.8150	0.8425	2.2950	0.8425
5Y	0.8525	-4.00	0.9160	0.9816	1.0565	1.8225	0.8525	2.3400	0.8525
7Y	0.8700	-4.00	0.9315	0.9884	1.0575	1.8400	0.8700	2.3950	0.8700
10Y	0.9200	-4.00	0.9815	1.0351	1.0949	1.9000	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	0.9225	-4.00	0.9840	1.0288	1.0785	1.9200	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.8825	-4.00	0.9440	0.9841	1.0343	1.9250	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7400	-4.00	0.8015	0.8435	0.8987	1.9100	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-5.75	-0.75	-4.40	-4.44	-4.29	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-4.00	-0.25	-3.35	-3.53	-3.45	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-2.50	-0.75	-1.65	-0.06	-2.15	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.25	-0.50	2.25	2.48	0.62	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	4.75	-0.75	5.00	5.60	2.76	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	5.75	-1.50	6.85	7.56	3.81	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.50	-0.25	2.75	3.13	2.14	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	3.50	-1.00	4.60	5.09	3.19	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.00	-0.75	1.85	1.96	1.05	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	1.75	0.00	1.55	0.68	0.10	1.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	6.75	0.00	6.55	5.35	3.83	7.75	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	0.00	5.00	4.68	3.73	6.00	1.50	12.75	1.50
10*12Y	0.25	0.00	0.25	-0.64	-1.63	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-3.75	0.00	-3.75	-5.10	-6.05	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-18.00	0.00	-18.00	-19.16	-19.62	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.739	-1.60	0.771	0.823	0.993	1.918	0.739	1.935	0.739
1.5Y	0.817	-1.50	0.845	0.908	1.035	1.932	0.817	2.113	0.817
2Y	0.882	-1.80	0.914	0.959	1.068	1.944	0.882	2.230	0.882
3Y	0.910	-2.50	0.957	0.999	1.057	1.846	0.022	2.315	0.022
4Y	1.080	-3.20	1.125	1.162	1.231	1.915	1.070	2.502	1.070
5Y	1.162	-4.30	1.211	1.236	1.275	1.915	1.110	2.602	1.110
7Y	1.284	-4.50	1.340	1.358	1.395	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.425	-4.50	1.485	1.494	1.500	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.537	-4.80	1.601	1.599	1.569	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.08	0.00
CALL	0.71	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.94	0.10	111.88	111.94	111.85
LKTB	133.13	0.48	132.85	133.17	132.74

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	8.10	-0.15	9.34	8.41	4.74	12.25	-5.30	12.25	-17.75
1.5Y	-0.95	-0.50	0.83	-0.30	-0.70	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-8.70	-0.70	-6.63	-5.31	-4.99	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-9.25	-0.50	-8.68	-6.86	-3.26	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-23.75	-0.05	-22.71	-19.98	-18.46	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-30.95	0.30	-29.54	-25.47	-21.84	-6.70	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-41.40	0.50	-40.87	-36.99	-33.74	-12.20	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-50.50	0.50	-50.31	-45.85	-40.47	-11.20	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-79.70	0.80	-79.97	-75.55	-67.07	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-102.50	12.75
-103.75	10.00
-105.00	7.25
-106.25	7.50
-107.25	7.25
-105.25	8.00
-94.50	8.00
-81.50	8.00

CRS

USD/KRW 1219.90 (-5.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-0.2050	11.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-5.00	-6.25
1.5Y	-0.2300	8.00	1.3150	1.1000	2*3Y	1.00	-0.25
2Y	-0.2550	4.75	1.2450	1.1000	2*5Y	5.50	-0.75
3Y	-0.2450	4.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	1.50	-0.50
4Y	-0.2300	4.00	1.2000	-0.4750	3*5Y	4.50	-0.50
5Y	-0.2000	4.00	1.1950	-0.4100	4*5Y	3.00	0.00
7Y	-0.0750	4.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.50	0.00
10Y	0.1050	4.00	1.4150	-0.1250	5*10Y	30.50	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	0.1608	0.0318	0.1290	0.1843	0.1881	2.7785	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6895	0.0533	0.6362	0.7054	0.6408	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	-72.12	4.98	-77.10	-73.07	-72.89	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-73.55	9.83	-83.38	-80.96	-85.52	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	12.50	-1.50	14.00	13.75	13.00	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	54.30	-2.70	57.00	60.00	57.90	61.40	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	52.87	2.15	50.72	52.11	45.27	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	90.75	ODD Tenor	
09M	86.25 / 86.75 / 85.75		
01Y	82.75 / 82.5 / 82 / 82.25		
1.5Y			
02Y	78.75	SPRD	9*1y 04 / -4
03Y	82 / 81.75		
04Y	85 / 84.75 / 84.5		
05Y	85 / 84.75		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	103 건	-9	112	78	101	100	56	74
금 액	39,412 억원	-7,953	47,365	38,098	47,120	43,787	18,405	23,085

장중동향

국고채 금리. 전 구간 하락. 간밤 미국에서 기준금리가 마이너스로 갈 수 있다는 베팅이 나오면서 국내 통화 정책 기대감을 강화해 채권시장 강세 재료로 작용.

IRS. 전 구간 하락. 양도성예금증서(CD) 2개월물이 낮은 금리에 발행되면서 IRS도 금리가 하락. 또 기준금리 인하에 베팅하는 외국인의 오퍼도 있었음.

CRS. 전 구간 상승. 마감