

IPS Daily Morning Brief

2020-05-12

종가 기준일 2020-05-11

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9200	0.25	0.9310	0.9828	1.1103	1.9125	0.9175	1.9125	0.9175
9M	0.8650	0.50	0.8835	0.9380	1.0669	1.8950	0.8600	1.9125	0.8600
1Y	0.8275	0.75	0.8485	0.9028	1.0323	1.8800	0.8200	1.9200	0.8200
1.5Y	0.8200	1.25	0.8375	0.8996	1.0203	1.8700	0.8075	2.0250	0.8075
2Y	0.8225	2.75	0.8320	0.8995	1.0113	1.8425	0.7950	2.1150	0.7950
3Y	0.8475	3.00	0.8550	0.9235	1.0179	1.8175	0.8175	2.2225	0.8175
4Y	0.8725	3.00	0.8820	0.9530	1.0397	1.8150	0.8425	2.2950	0.8425
5Y	0.8825	3.00	0.8975	0.9715	1.0503	1.8225	0.8525	2.3400	0.8525
7Y	0.9000	3.00	0.9140	0.9788	1.0515	1.8400	0.8700	2.3950	0.8700
10Y	0.9500	3.00	0.9640	1.0251	1.0890	1.9000	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	0.9525	3.00	0.9665	1.0208	1.0724	1.9200	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9125	3.00	0.9265	0.9768	1.0278	1.9250	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7700	3.00	0.7840	0.8363	0.8911	1.9100	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-5.50	0.25	-4.75	-4.48	-4.33	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.75	0.25	-3.50	-3.53	-3.47	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-0.50	2.00	-1.65	-0.33	-2.10	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.50	0.25	2.30	2.40	0.67	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	5.00	0.25	5.00	5.35	2.84	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	6.00	0.25	6.55	7.20	3.90	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.50	0.00	2.70	2.95	2.18	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	3.50	0.00	4.25	4.80	3.24	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.00	0.00	1.55	1.85	1.06	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	1.75	0.00	1.65	0.73	0.12	1.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	6.75	0.00	6.65	5.36	3.87	7.75	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	0.00	5.00	4.64	3.75	6.00	1.50	12.75	1.50
10*12Y	0.25	0.00	0.25	-0.44	-1.65	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-3.75	0.00	-3.75	-4.84	-6.12	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-18.00	0.00	-18.00	-18.89	-19.79	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.729	-1.00	0.758	0.816	0.984	1.918	0.729	1.935	0.729
1.5Y	0.820	0.30	0.834	0.900	1.027	1.932	0.817	2.113	0.817
2Y	0.897	1.50	0.902	0.954	1.062	1.944	0.882	2.230	0.882
3Y	0.930	2.00	0.941	0.994	1.051	1.846	0.022	2.315	0.022
4Y	1.102	2.20	1.112	1.155	1.226	1.915	1.070	2.502	1.070
5Y	1.192	3.00	1.200	1.230	1.271	1.915	1.110	2.602	1.110
7Y	1.321	3.70	1.329	1.352	1.392	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.470	4.50	1.475	1.488	1.497	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.566	2.90	1.589	1.594	1.569	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.05	-3.00
CALL	0.72	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.85	-0.09	111.91	111.94	111.85
LKTb	132.70	-0.43	132.96	133.07	132.69

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	9.85	1.75	9.07	8.65	4.83	12.25	-5.30	12.25	-17.75
1.5Y	0.00	0.95	0.33	-0.04	-0.72	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-7.45	1.25	-7.02	-5.43	-5.11	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-8.25	1.00	-8.58	-7.00	-3.33	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-22.95	0.80	-23.02	-20.19	-18.66	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-30.95	0.00	-30.29	-25.86	-22.11	-7.45	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-42.10	-0.70	-41.52	-37.36	-34.02	-13.65	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-52.00	-1.50	-51.12	-46.30	-40.85	-11.20	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-79.60	0.10	-80.54	-75.79	-67.77	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS		USD/KRW				1220.50 (+0.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-89.75	12.75	1Y	-0.0700	13.50	1.3900	-1.4500	1*2Y	-11.00	-6.00
-94.50	9.25	1.5Y	-0.1250	10.50	1.3150	1.1000	2*3Y	-2.00	-3.00
-100.25	4.75	2Y	-0.1800	7.50	1.2450	1.1000	2*5Y	2.00	-3.50
-104.75	1.50	3Y	-0.2000	4.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	1.50	0.00
-105.75	1.50	4Y	-0.1850	4.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	4.00	-0.50
-104.25	1.00	5Y	-0.1600	4.00	1.1950	-0.4100	4*5Y	2.50	-0.50
-93.50	1.00	7Y	-0.0350	4.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.50	0.00
-81.00	0.50	10Y	0.1400	3.50	1.4150	-0.1250	5*10Y	30.00	-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	0.1847	0.0239	0.1608	0.1290	0.1843	2.7785	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.7140	0.0245	0.6895	0.6362	0.7054	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	-71.23	0.89	-72.12	-77.10	-73.07	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-75.60	-2.05	-73.55	-83.38	-80.96	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	12.75	0.25	12.50	14.00	13.75	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	57.30	3.00	54.30	57.00	60.00	61.40	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	52.93	0.06	52.87	50.72	52.11	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	81.5 / 82								
1.5Y									
02Y	80	SPRD							
03Y	82.5								
04Y									
05Y	86.25 / 85.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y crs -12								
	3y crs -19								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	52 건	-51	103	112	78	101	100	56	
금 액	10,100 억원	-29,312	39,412	47,365	38,098	47,120	43,787	18,405	

장중동향

국고채 금리, 지난주 채권시장 강세에 따른 레벨 부담이 작용한 가운데 국내 코로나19 재확산 우려가 장기를 중심으로 금리 상승 압력을 가함. 장 막판에는 국고 5년물 입찰 관련 손절형 국채선물 매도 물량이 몰리면서 약세폭을 키우며 국고채 금리 전 구간 상승.

IRS, 특이한 움직임은 없었고 국채 현물을 따라 전 구간 상승. IRS금리는 FX스와프의 상승 영향에 1년물이 큰 폭으로 상승.

CRS, 전 구간 상승. 마감