

IPS Daily Morning Brief

2020-05-13

종가 기준일 2020-05-12

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9050	-1.50	0.9215	0.9781	1.1029	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
9M	0.8475	-1.75	0.8700	0.9331	1.0590	1.8950	0.8475	1.9125	0.8475
1Y	0.8100	-1.75	0.8335	0.8978	1.0242	1.8800	0.8100	1.9200	0.8100
1.5Y	0.7950	-2.50	0.8220	0.8933	1.0123	1.8700	0.7950	2.0250	0.7950
2Y	0.7900	-3.25	0.8165	0.8921	1.0035	1.8425	0.7900	2.1150	0.7900
3Y	0.8125	-3.50	0.8400	0.9156	1.0105	1.8175	0.8125	2.2225	0.8125
4Y	0.8350	-3.75	0.8660	0.9441	1.0325	1.8150	0.8350	2.2950	0.8350
5Y	0.8475	-3.50	0.8800	0.9620	1.0433	1.8225	0.8475	2.3400	0.8475
7Y	0.8650	-3.50	0.8975	0.9699	1.0446	1.8400	0.8650	2.3950	0.8650
10Y	0.9150	-3.50	0.9475	1.0161	1.0823	1.9000	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	0.9175	-3.50	0.9500	1.0133	1.0655	1.9200	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.8775	-3.50	0.9100	0.9698	1.0205	1.9250	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7350	-3.50	0.7675	0.8289	0.8827	1.9100	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-5.75	-0.25	-5.15	-4.50	-4.38	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.75	0.00	-3.65	-3.54	-3.48	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-2.00	-1.50	-1.70	-0.56	-2.07	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.25	-0.25	2.35	2.35	0.70	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	4.50	-0.50	4.95	5.20	2.90	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	5.75	-0.25	6.35	6.99	3.98	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.25	-0.25	2.60	2.85	2.20	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	3.50	0.00	4.00	4.64	3.27	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.25	0.25	1.40	1.79	1.08	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	1.75	0.00	1.75	0.79	0.13	1.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	6.75	0.00	6.75	5.41	3.90	7.75	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	0.00	5.00	4.63	3.77	6.00	1.50	12.75	1.50
10*12Y	0.25	0.00	0.25	-0.29	-1.68	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-3.75	0.00	-3.75	-4.64	-6.18	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-18.00	0.00	-18.00	-18.73	-19.96	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.716	-1.30	0.743	0.811	0.974	1.918	0.716	1.935	0.716
1.5Y	0.804	-1.60	0.824	0.893	1.019	1.932	0.804	2.113	0.804
2Y	0.858	-3.90	0.890	0.948	1.054	1.944	0.858	2.230	0.858
3Y	0.885	-4.50	0.923	0.987	1.044	1.846	0.022	2.315	0.022
4Y	1.060	-4.20	1.098	1.148	1.221	1.915	1.060	2.502	1.060
5Y	1.140	-5.20	1.186	1.224	1.267	1.915	1.110	2.602	1.110
7Y	1.274	-4.70	1.314	1.347	1.387	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.430	-4.00	1.462	1.484	1.494	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.537	-2.90	1.572	1.591	1.567	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.05	0.00
CALL	0.72	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	112.00	0.15	111.87	112.02	111.85
LKTb	133.05	0.35	132.71	133.26	132.67

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	9.40	-0.45	9.07	8.72	5.01	12.25	-5.30	12.25	-17.75
1.5Y	-0.90	-0.90	-0.18	0.06	-0.63	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-6.80	0.65	-7.39	-5.57	-5.08	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-7.25	1.00	-8.34	-7.14	-3.39	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-22.50	0.45	-23.22	-20.43	-18.86	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-29.25	1.70	-30.58	-26.24	-22.35	-7.45	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-40.90	1.20	-41.69	-37.74	-34.26	-13.65	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-51.50	0.50	-51.45	-46.79	-41.21	-11.20	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-80.20	-0.60	-80.49	-76.23	-68.48	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1224.80 (+4.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-84.00	5.75	1Y	-0.0300	4.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-11.50	-0.50		
-89.00	5.50	1.5Y	-0.0950	3.00	1.3150	1.1000	2*3Y	-2.00	0.00		
-93.50	6.75	2Y	-0.1450	3.50	1.2450	1.1000	2*5Y	2.00	0.00		
-97.75	7.00	3Y	-0.1650	3.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	1.50	0.00		
-98.50	7.25	4Y	-0.1500	3.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	4.00	0.00		
-97.25	7.00	5Y	-0.1250	3.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	2.50	0.00		
-86.50	7.00	7Y	0.0000	3.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.50	0.00		
-74.00	7.00	10Y	0.1750	3.50	1.4150	-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	0.1648	-0.0199	0.1847	0.1608	0.1290	2.7785	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6708	-0.0432	0.7140	0.6895	0.6362	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	-69.32	1.91	-71.23	-72.12	-77.10	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-75.92	-0.32	-75.60	-73.55	-83.38	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	-0.25	12.75	12.50	14.00	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	57.20	-0.10	57.30	54.30	57.00	61.40	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	50.60	-2.33	52.93	52.87	50.72	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	80.25 / 80.50	SPRD	1*2y -2.25						
03Y	82.5 / 82		5*10y 6.75						
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y CCS -22								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	89 건	37	52	103	112	78	101	100	
금 액	28,681 억원	18,581	10,100	39,412	47,365	38,098	47,120	43,787	

장중동향
국고채 금리. 전 구간 하락. 외국인인 국채선물 매수로 강세를 주도했고, 지원 업종을 7개에서 2개로 줄인 정부의 기간산업지원 방침도 강세 재료로 작용.

IRS. 전 구간 하락. 외국인 국채선물 매수와 기간산업 기금 조성 소식 등이 강세 요인으로 작용하며 거래가 많지는 않았음. IRS 2년 금리가 0.80%대 밑으로 내리자 비드가 나오면서 추가 강세는 제한 됨.

CRS. 전 구간 상승. 마감