IPS Daily Morning Brief

2020-05-19

종가 기준일 2020-05-18

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9225	-0.25	0.9175	0.9609	1.0735	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
9M	0.8650	0.25	0.8550	0.9126	1.0273	1.8950	0.8425	1.9125	0.8425
1Y	0.8300	0.75	0.8145	0.8769	0.9912	1.8800	0.7975	1.9200	0.7975
1.5Y	0.8275	1.75	0.8020	0.8700	0.9797	1.8700	0.7800	2.0250	0.7800
2Y	0.8250	2.25	0.7955	0.8669	0.9718	1.8425	0.7725	2.1150	0.7725
3Y	0.8375	3.00	0.8070	0.8869	0.9796	1.8125	0.7850	2.2225	0.7850
4Y	0.8575	3.00	0.8280	0.9130	1.0027	1.8075	0.8075	2.2950	0.8075
5Y	0.8725	3.25	0.8410	0.9296	1.0143	1.8050	0.8200	2.3400	0.8200
7Y	0.8775	3.50	0.8500	0.9383	1.0158	1.8125	0.8325	2.3950	0.8325
10Y	0.9225	3.50	0.8960	0.9844	1.0541	1.8600	0.8775	2.4850	0.8775
12Y	0.9300	3.50	0.9015	0.9868	1.0369	1.8850	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9300	3.50	0.8935	0.9533	0.9929	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7500	3.50	0.7190	0.8029	0.8487	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975
6*9M	-5.75	0.50	-6.25	-4.83	-4.62	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.50	0.50	-4.05	-3.58	-3.61	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-0.50	1.50	-1.90	-1.00	-1.93	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	1.25	0.75	1.15	2.00	0.78	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	3.25	0.75	3.25	4.61	3.08	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	4.75	1.00	4.55	6.28	4.24	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.00	0.00	2.10	2.61	2.31	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	3.50	0.25	3.40	4.28	3.47	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.50	0.25	1.30	1.66	1.16	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.50	0.25	0.90	0.86	0.15	1.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	5.00	0.25	5.50	5.48	3.98	7.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.50	0.00	4.60	4.61	3.83	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	0.75	0.00	0.55	0.24	-1.72	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	0.75	0.00	-0.25	-3.11	-6.12	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-17.25	0.00	-17.70	-18.15	-20.54	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.691	-0.60	0.707	0.783	0.937	1.918	0.691	1.935	0.691
1.5Y	0.782	0.20	0.790	0.864	0.987	1.932	0.780	2.113	0.780
2Y	0.854	1.20	0.846	0.925	1.026	1.944	0.837	2.230	0.837
3Y	0.885	1.50	0.872	0.963	1.016	1.846	0.022	2.315	0.022
4Y	1.031	0.60	1.037	1.125	1.198	1.910	1.025	2.502	1.025
5Y	1.130	1.80	1.122	1.206	1.247	1.910	1.110	2.602	1.110
7Y	1.251	1.70	1.249	1.330	1.368	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.395	1.80	1.397	1.470	1.480	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.506	2.10	1.505	1.580	1.559	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.05	0.00
CALL	0.71	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	112.02	-0.05	112.08	112.08	112.00
LKTB	133.55	-0.15	133.70	133.70	133.47

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	13.90	1.35	10.77	9.41	5.38	13.90	-5.30	13.90	-17.75
1.5Y	4.55	1.55	1.16	0.59	-0.69	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-2.90	1.05	-5.01	-5.85	-5.43	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-4.75	1.50	-6.50	-7.59	-3.64	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-17.35	2.40	-20.92	-21.22	-19.58	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-25.75	1.45	-28.14	-27.64	-23.28	-7.45	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-37.35	1.80	-39.90	-39.22	-35.24	-15.60	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-47.25	1.70	-50.12	-48.56	-42.57	-12.20	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-75.60	1.40	-78.58	-77.71	-71.03	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-84.50	1.25
-87.75	-0.75
-90.00	-2.25
-90.75	-2.50
-91.25	-2.00
-89.25	-2.75
-77.75	-3.00
-65.25	-3.00

CRS

USD/KRW 1232.40 (+1.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-0.0150	2.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-6.00	-2.00
1.5Y	-0.0500	1.00	1.3150	1.1000	2*3Y	0.50	0.50
2Y	-0.0750	0.00	1.2450	1.1100	2*5Y	5.50	0.50
3Y	-0.0700	0.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	1.50	0.50
4Y	-0.0550	1.00	1.2000	-0.4750	3*5Y	5.00	0.00
5Y	-0.0200	0.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	3.50	-0.50
7Y	0.1000	0.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00
10Y	0.2700	0.50	1.4150	-0.1250	5*10Y	29.00	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	0.1732	0.0241	0.1491	0.1490	0.1609	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.7282	0.0822	0.6460	0.6202	0.6492	2.8556	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	-68.08	1.21	-69.29	-68.80	-67.61	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-66.68	6.42	-73.10	-77.18	-74.28	87.38	-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	9.75	1.25	8.50	9.00	10.50	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	54.10	0.60	53.50	55.50	55.50	61.40	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	55.50	5.81	49.69	47.12	48.83	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M	92.25	ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	82.75		
02Y	82	SPRD	8*12y 4.5
03Y	82.5		5*10y 5 / 5.25
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	91		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	4y CCR -04		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	90 건	52	38	55	91	89	52	103
금 액	23,528 억원	15,075	8,453	14,626	24,380	28,681	10,100	39,412

장중동향

국고채 금리. 국고 10년물 입찰이 무난하게 진행됐지만 국내 기관을 중심으로 물량 부담이 작용. 장 막판에는 미국 국채금리가 상승하면서 약세로 마감한것으로 풀이 되며 국고채 금리 상승.

IRS. 전 구간 상승. 전반적으로 3bp씩 올랐고, 테너별로 큰 차이는 없었으며 현물과 함께 상승했지만 스와프 시장 수급에 따라 IRS 금리의 상승폭은 더 높았음.

CRS. 전 구간 상승. 마감