

IPS Daily Morning Brief

2020-05-20

종가 기준일 2020-05-19

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9150	-0.75	0.9195	0.9561	1.0661	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
9M	0.8600	-0.50	0.8575	0.9075	1.0195	1.8950	0.8425	1.9125	0.8425
1Y	0.8275	-0.25	0.8180	0.9070	0.9833	1.8800	0.7975	1.9200	0.7975
1.5Y	0.8250	-0.25	0.8080	0.8654	0.9721	1.8700	0.7800	2.0250	0.7800
2Y	0.8250	0.00	0.8025	0.8625	0.9647	1.8425	0.7725	2.1150	0.7725
3Y	0.8375	0.00	0.8120	0.8824	0.9728	1.8125	0.7850	2.2225	0.7850
4Y	0.8650	0.75	0.8340	0.9088	0.9963	1.8075	0.8075	2.2950	0.8075
5Y	0.8850	1.25	0.8485	0.9261	1.0083	1.8050	0.8200	2.3400	0.8200
7Y	0.8925	1.50	0.8555	0.9351	1.0100	1.8125	0.8325	2.3950	0.8325
10Y	0.9450	2.25	0.9020	0.9821	1.0488	1.8600	0.8775	2.4850	0.8775
12Y	0.9525	2.25	0.9085	0.9853	1.0315	1.8850	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9525	2.25	0.9085	0.9541	0.9877	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7725	2.25	0.7265	0.8015	0.8420	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-5.50	0.25	-6.20	-4.86	-4.66	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.25	0.25	-3.95	-3.55	-3.62	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-0.25	0.25	-1.55	-0.95	-1.86	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	1.25	0.00	0.95	1.99	0.81	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	4.00	0.75	3.15	4.63	3.16	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	6.00	1.25	4.60	6.36	4.36	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.75	0.75	2.20	2.64	2.35	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	4.75	1.25	3.65	4.38	3.55	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.00	0.50	1.45	1.74	1.20	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.75	0.25	0.70	0.90	0.17	1.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	6.00	1.00	5.35	5.60	4.05	7.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.25	0.75	4.65	4.70	3.88	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	0.75	0.00	0.65	0.31	-1.73	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	0.75	0.00	0.65	-2.80	-6.10	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-17.25	0.00	-17.55	-18.06	-20.68	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	0.00	0.702	0.774	0.928	1.918	0.691	1.935	0.691
1.5Y	0.781	-0.10	0.786	0.857	0.979	1.932	0.780	2.113	0.780
2Y	0.845	-0.90	0.843	0.920	1.019	1.944	0.837	2.230	0.837
3Y	0.875	-1.00	0.870	0.957	1.009	1.846	0.022	2.315	0.022
4Y	1.022	-0.90	1.030	1.120	1.193	1.910	1.022	2.502	1.022
5Y	1.127	-0.30	1.120	1.203	1.243	1.910	1.110	2.602	1.110
7Y	1.249	-0.20	1.244	1.328	1.364	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.392	-0.30	1.390	1.469	1.477	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.519	1.30	1.501	1.579	1.558	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비	국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
91d CD	1.02	-3.00	KTb	112.05	0.03	111.95	112.10	111.94
CALL	0.72	1.00	LKTB	133.53	-0.02	133.18	133.76	133.14

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	13.65	-0.25	11.62	9.80	5.51	13.90	-5.30	13.90	-17.75
1.5Y	4.40	-0.15	2.22	0.87	-0.67	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-2.00	0.90	-4.05	-5.71	-5.45	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-3.75	1.00	-5.80	-7.47	-3.64	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-15.70	1.65	-19.56	-21.09	-19.68	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-24.20	1.55	-27.13	-27.66	-23.46	-7.45	-33.30	-1.25	-33.30
7Y	-35.65	1.70	-38.85	-39.27	-35.43	-15.60	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-44.70	2.55	-48.76	-48.65	-42.83	-12.20	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-74.65	0.95	-77.47	-77.71	-71.61	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1225.30 (-7.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-72.25	12.25	1Y	0.1050	12.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-11.50	-5.50		
-78.50	9.25	1.5Y	0.0400	9.00	1.3150	1.1000	2*3Y	0.50	0.00		
-83.50	6.50	2Y	-0.0100	6.50	1.2450	1.1100	2*5Y	5.50	0.00		
-84.25	6.50	3Y	-0.0050	6.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	1.50	0.00		
-85.50	5.75	4Y	0.0100	6.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	5.00	0.00		
-84.00	5.25	5Y	0.0450	6.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	3.50	0.00		
-72.75	5.00	7Y	0.1650	6.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-61.00	4.25	10Y	0.3350	6.50	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	0.1612	-0.0120	0.1732	0.1491	0.1490	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6964	-0.0318	0.7282	0.6460	0.6202	2.8187	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	-68.38	-0.3	-68.08	-69.29	-68.80	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-69.56	-2.88	-66.68	-73.10	-77.18	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	12.00	2.25	9.75	8.50	9.00	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	54.70	0.60	54.10	53.50	55.50	61.40	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	53.52	-1.98	55.50	49.69	47.12	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	82.5	SPRD							
03Y									
04Y	85.25								
05Y	89 / 89.5 / 87.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	57 건	-33	90	38	55	91	89	52	
금 액	15,977 억원	-7,551	23,528	8,453	14,626	24,380	28,681	10,100	

장중동향
국고채 금리, 전 구간 소폭 하락. 채권시장은 코로나19 백신 실험 소식에 약세로 출발했지만 한국은행의 기준금리 인하에 대한 기대와 외국인의 국채선물 매수 등에 약세를 만회한 뒤 마감.

IRS, 전 구간 상승. 단기 구간은 양도성예금증서(CD) 발행 영향에 소폭 강세를 보임. 장 초반 위험자산 선호현상을 보이다가 CD가 낮게 발행되면서 단기 구간은 강세를 나타냄. IRS거래가 극히 적었으며 CRS금리는 급등하면서 정상화 기조를 이어감.

CRS, 전 구간 큰 폭 상승. 마감