IPS Daily Morning Brief

2020-05-26

종가 기준일 2020-05-25

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9075	0.50	0.9075	0.9356	1.0393	1.9125	0.9025	1.9125	0.9025
9M	0.8475	0.50	0.8500	0.8839	0.9914	1.8950	0.8425	1.9125	0.8425
1Y	0.8150	0.50	0.8175	0.8489	0.9550	1.8800	0.7975	1.9200	0.7975
1.5Y	0.7975	0.25	0.8090	0.8403	0.9455	1.8650	0.7800	2.0250	0.7800
2Y	0.7850	0.50	0.8015	0.8354	0.9402	1.8425	0.7725	2.1150	0.7725
3Y	0.7875	0.25	0.8095	0.8530	0.9500	1.8125	0.7850	2.2225	0.7850
4Y	0.8050	0.25	0.8315	0.8789	0.9753	1.8075	0.8025	2.2950	0.8025
5Y	0.8125	-0.50	0.8480	0.8969	0.9886	1.8050	0.8125	2.3400	0.8125
7Y	0.8200	-0.75	0.8560	0.9071	0.9910	1.8125	0.8200	2.3950	0.8200
10Y	0.8700	-0.75	0.9070	0.9558	1.0313	1.8600	0.8700	2.4850	0.8700
12Y	0.8800	-0.75	0.9165	0.9608	1.0139	1.8850	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.8800	-0.75	0.9165	0.9386	0.9713	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7200	-0.75	0.7475	0.7814	0.8210	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975
6*9M	-6.00	0.00	-5.75	-5.18	-4.79	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.25	0.00	-3.25	-3.50	-3.63	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-3.00	0.00	-1.60	-1.35	-1.49	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.25	-0.25	0.80	1.76	0.99	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	2.00	-0.25	3.00	4.35	3.51	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	2.75	-1.00	4.65	6.15	4.84	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.75	0.00	2.20	2.59	2.53	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	2.50	-0.75	3.85	4.39	3.85	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	0.75	-0.75	1.65	1.80	1.33	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.75	-0.25	0.80	1.03	0.24	1.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	5.75	-0.25	5.90	5.89	4.28	7.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	0.00	5.10	4.86	4.03	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	1.00	0.00	0.95	0.50	-1.75	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	1.00	0.00	0.95	-1.71	-6.00	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-15.00	0.00	-15.95	-17.44	-21.03	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.680	-0.60	0.688	0.738	0.896	1.918	0.680	1.935	0.680
1.5Y	0.763	-0.40	0.774	0.824	0.952	1.932	0.763	2.113	0.763
2Y	0.800	-0.70	0.824	0.885	0.995	1.944	0.800	2.230	0.800
3Y	0.812	-2.00	0.849	0.921	0.986	1.846	0.022	2.315	0.022
4Y	0.967	-1.80	0.998	1.085	1.176	1.910	0.967	2.502	0.967
5Y	1.050	-2.00	1.092	1.172	1.230	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.171	-2.30	1.210	1.298	1.352	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.312	-2.80	1.349	1.442	1.469	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.457	-1.30	1.480	1.556	1.557	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.02	0.00
CALL	0.71	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	112.23	0.03	112.17	112.25	112.16
LKTB	134.40	0.32	134.04	134.47	133.97

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	13.50	1.10	12.99	11.04	5.90	13.90	-5.30	13.90	-17.75
1.5Y	3.45	0.65	3.46	1.61	-0.65	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-1.50	1.20	-2.27	-4.97	-5.53	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-2.45	2.25	-3.97	-6.75	-3.61	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-16.20	2.05	-16.69	-20.58	-20.09	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-23.75	1.50	-24.38	-27.53	-24.12	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-35.10	1.55	-35.38	-39.08	-36.05	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-44.20	2.05	-44.20	-48.63	-43.77	-12.20	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-73.70	0.55	-73.29	-77.45	-73.63	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-74.50	6.50
-84.75	6.25
-92.50	5.50
-92.25	6.25
-95.00	5.75
-94.25	6.00
-83.00	6.25
-74.50	6.25

CRS

USD/KRW 1244.20 (+7.20)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.0700	7.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-21.00	-1.00
1.5Y	-0.0500	6.50	1.3150	1.1450	2*3Y	0.50	0.50
2Y	-0.1400	6.00	1.2450	1.1050	2*5Y	1.00	-0.50
3Y	-0.1350	6.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	-1.00	-0.50
4Y	-0.1450	6.00	1.2000	-0.4750	3*5Y	0.50	-1.00
5Y	-0.1300	5.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	1.50	-0.50
7Y	-0.0100	5.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00
10Y	0.1250	5.50	1.4150	-0.1250	5*10Y	25.50	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	0.1737	0.0000	0.1737	0.1573	0.1613	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6607	0.0000	0.6607	0.6728	0.6826	2.8073	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	-62.63	0.7	-63.33	-67.47	-67.57	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-65.13	2.80	-67.93	-66.82	-67.74	87.03	-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	8.50	-1.25	9.75	10.75	11.75	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	51.20	-2.10	53.30	50.90	52.30	61.40	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	48.70	0.00	48.70	51.55	52.13	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	79		
02Y		SPRD	3*5y 3.25
03Y	78		
04Y			
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	58 건	-36	94	119	85	57	90	38
금 액	18,545 억원	-4,818	23,363	42,466	27,108	15,977	23,528	8,453

장중동향

국고채 금리. 전 구간 하락. 5년 이하 구간에서 금리는 사상 최저치를 경신. 5월 한국은행 금통위를 향한 기준금리 인하 기대 속에서 국고 20년물 입찰 호조 등으로 강세 분위기가 지속. 장중에 3차 추경 이슈가 악세 재료로 작용했지만 대기 매수세가 유입하면서 금리가 하락 마감.

IRS. 금리 수익률 곡선이 평탄화 (커브 플래트닝) 흐름을 나타냄. 현물 채권 강세와 달리 IRS시장에서는 비드(매도)가 우위를 보인 결과로 풀이됨. 증권사의 본드스와프 움직임이 있는 것 같으며 비드가 강해 단기금리는 상승했고 장기금리도 소폭 하락에 그침. 장기금리도 현물 채권 금리의 하락세에 비하면 비드가 매우 강했던 것.

CRS. 전 구간 상승. 마감