

IPS Daily Morning Brief

2020-05-27

종가 기준일 2020-05-26

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9150	0.75	0.9075	0.9313	1.0328	1.9125	0.9025	1.9125	0.9025
9M	0.8600	1.25	0.8500	0.8788	0.9848	1.8950	0.8425	1.9125	0.8425
1Y	0.8300	1.50	0.8180	0.8440	0.9487	1.8800	0.7975	1.9200	0.7975
1.5Y	0.8150	1.75	0.8070	0.8346	0.9397	1.8650	0.7800	2.0250	0.7800
2Y	0.8100	2.50	0.7985	0.8293	0.9348	1.8425	0.7725	2.1150	0.7725
3Y	0.8100	2.25	0.8040	0.8456	0.9453	1.8125	0.7850	2.2225	0.7850
4Y	0.8275	2.25	0.8240	0.8706	0.9710	1.8000	0.8025	2.2950	0.8025
5Y	0.8400	2.75	0.8390	0.8880	0.9846	1.7975	0.8125	2.3400	0.8125
7Y	0.8500	3.00	0.8475	0.8986	0.9873	1.8100	0.8200	2.3950	0.8200
10Y	0.8975	2.75	0.8975	0.9474	1.0278	1.8600	0.8700	2.4850	0.8700
12Y	0.9075	2.75	0.9075	0.9528	1.0103	1.8850	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9075	2.75	0.9075	0.9328	0.9681	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7475	2.75	0.7425	0.7748	0.8170	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-5.50	0.50	-5.75	-5.25	-4.79	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.00	0.25	-3.20	-3.48	-3.62	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-2.00	1.00	-1.95	-1.48	-1.38	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.00	-0.25	0.55	1.64	1.04	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	1.75	-0.25	2.55	4.14	3.61	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	3.00	0.25	4.05	5.88	4.98	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.75	0.00	2.00	2.50	2.57	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	3.00	0.50	3.50	4.24	3.94	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.25	0.50	1.50	1.74	1.37	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	1.00	0.25	0.85	1.06	0.26	1.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	5.75	0.00	5.85	5.94	4.32	7.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.75	-0.25	5.00	4.88	4.06	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	1.00	0.00	1.00	0.54	-1.75	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	1.00	0.00	1.00	-1.46	-5.98	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-15.00	0.00	-15.50	-17.26	-21.08	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.671	-0.90	0.684	0.731	0.888	1.918	0.671	1.935	0.671
1.5Y	0.764	0.10	0.771	0.816	0.946	1.932	0.763	2.113	0.763
2Y	0.820	2.00	0.819	0.877	0.990	1.944	0.800	2.230	0.800
3Y	0.842	3.00	0.843	0.911	0.981	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	1.000	3.30	0.994	1.074	1.173	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.082	3.20	1.083	1.162	1.227	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.200	2.90	1.200	1.287	1.349	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.337	2.50	1.338	1.431	1.468	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.460	0.30	1.469	1.547	1.558	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	112.10	-0.13	112.24	112.32	112.10
LKTb	134.15	-0.25	134.41	134.79	134.07

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	15.90	2.40	13.44	11.35	6.02	15.90	-5.30	15.90	-17.75
1.5Y	5.10	1.65	3.60	1.86	-0.62	5.10	-10.20	5.10	-19.10
2Y	-1.00	0.50	-2.07	-4.74	-5.53	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-3.20	-0.75	-3.86	-6.56	-3.60	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-17.25	-1.05	-17.00	-20.37	-20.19	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-24.20	-0.45	-24.38	-27.37	-24.25	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-35.00	0.10	-35.25	-38.87	-36.19	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-43.95	0.25	-44.05	-48.41	-44.00	-12.20	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-71.25	2.45	-72.61	-77.24	-74.07	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1234.30 (-9.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-74.00	0.50	1Y	0.0900	2.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-19.00	2.00		
-83.00	1.75	1.5Y	-0.0150	3.50	1.3150	1.1450	2*3Y	0.50	0.00		
-91.00	1.50	2Y	-0.1000	4.00	1.2450	1.1000	2*5Y	2.00	1.00		
-90.50	1.75	3Y	-0.0950	4.00	1.2150	-0.5650	3*4Y	-0.50	0.50		
-92.75	2.25	4Y	-0.1000	4.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	1.50	1.00		
-92.00	2.25	5Y	-0.0800	5.00	1.1950	-0.4100	4*5Y	2.00	0.50		
-81.00	2.00	7Y	0.0400	5.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-72.25	2.25	10Y	0.1750	5.00	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	0.1834	0.0097	0.1737	0.1737	0.1573	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.7006	0.0399	0.6607	0.6607	0.6728	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	-63.66	-1.03	-62.63	-63.33	-67.47	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-63.64	1.49	-65.13	-67.93	-66.82	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	8.75	0.25	8.50	9.75	10.75	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	51.70	0.50	51.20	53.30	50.90	61.40	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	51.72	3.02	48.70	48.70	51.55	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	80.75	SPRD	6*12m -8.5						
03Y			4*5y 1						
04Y	78.75								
05Y	79.25								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	123 건	65	58	94	119	85	57	90	
금 액	60,835 억원	42,290	18,545	23,363	42,466	27,108	15,977	23,528	

장중동향
국고채 금리. 장중에 외국인이 3년 국채선물을 1만계약 가까이 매도하며 약세를 주도하는 가운데 이를 앞으로 다가온 한국은행 금융통화위원회를 앞두고 최근 강세에 따른 경계감도 일부 작용하며 국고채 금리 전 구간 상승.

IRS. 별 다른 움직임이 없었고, 국고채 현물 금리가 오후 들어 상승하면서 같이 약세를 나타내며 전 구간 상승. 이날 채권시장은 오후 들어 주식시장 강세 등 글로벌 위험선호에 약세로 반전하는 모습을 보임.

CRS. 전 구간 상승. 마감