

IPS Daily Morning Brief

2020-05-28

종가 기준일 2020-05-27

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9150	0.00	0.9090	0.9279	1.0257	1.9125	0.9025	1.9125	0.9025
9M	0.8600	0.00	0.8515	0.8746	0.9775	1.8950	0.8425	1.9125	0.8425
1Y	0.8300	0.00	0.8200	0.8400	0.9415	1.8800	0.7975	1.9200	0.7975
1.5Y	0.8175	0.25	0.8070	0.8303	0.9329	1.8650	0.7800	2.0250	0.7800
2Y	0.8150	0.50	0.7985	0.8250	0.9286	1.8425	0.7725	2.1150	0.7725
3Y	0.8150	0.50	0.8015	0.8398	0.9395	1.8125	0.7850	2.2225	0.7850
4Y	0.8300	0.25	0.8195	0.8638	0.9657	1.8000	0.8025	2.2950	0.8025
5Y	0.8400	0.00	0.8325	0.8804	0.9797	1.7975	0.8125	2.3400	0.8125
7Y	0.8475	-0.25	0.8410	0.8911	0.9826	1.8100	0.8200	2.3950	0.8200
10Y	0.8950	-0.25	0.8900	0.9401	1.0235	1.8600	0.8700	2.4850	0.8700
12Y	0.9050	-0.25	0.9000	0.9459	1.0060	1.8850	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9050	-0.25	0.9000	0.9279	0.9641	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7450	-0.25	0.7375	0.7690	0.8123	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-5.50	0.00	-5.75	-5.33	-4.81	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-3.00	0.00	-3.15	-3.46	-3.60	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	-1.50	0.50	-2.15	-1.50	-1.29	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	0.00	0.00	0.30	1.48	1.08	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	1.50	-0.25	2.10	3.88	3.70	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	2.50	-0.50	3.40	5.54	5.11	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	1.50	-0.25	1.80	2.40	2.62	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	2.50	-0.50	3.10	4.06	4.03	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.00	-0.25	1.30	1.66	1.40	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.75	-0.25	0.85	1.08	0.29	1.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	5.50	-0.25	5.75	5.98	4.38	7.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.75	0.00	4.90	4.90	4.10	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	1.00	0.00	1.00	0.58	-1.75	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	1.00	0.00	1.00	-1.23	-5.95	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-15.00	0.00	-15.25	-17.11	-21.13	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.670	-0.10	0.679	0.724	0.880	1.918	0.670	1.935	0.670
1.5Y	0.764	0.00	0.768	0.809	0.939	1.932	0.763	2.113	0.763
2Y	0.820	0.00	0.816	0.870	0.984	1.944	0.800	2.230	0.800
3Y	0.850	0.80	0.839	0.903	0.992	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	1.005	0.50	0.992	1.066	1.169	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.083	0.10	1.076	1.153	1.224	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.197	-0.30	1.194	1.278	1.346	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.331	-0.60	1.332	1.421	1.466	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.447	-1.30	1.461	1.538	1.557	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.02	0.00
CALL	0.73	2.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	112.10	0.00	112.14	112.17	112.03
LKTB	134.25	0.10	134.25	134.49	134.05

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	16.00	0.10	14.06	11.57	6.15	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	5.35	0.25	3.94	2.10	-0.60	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	-0.50	0.50	-1.73	-4.46	-5.53	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-3.50	-0.30	-3.77	-6.37	-5.27	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-17.50	-0.25	-17.25	-20.18	-20.30	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-24.30	-0.10	-24.39	-27.27	-24.39	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-34.95	0.05	-35.32	-38.66	-36.33	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-43.60	0.35	-44.22	-48.11	-44.24	-12.20	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-70.20	1.05	-72.33	-76.90	-74.48	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1234.40 (+0.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-76.00	-2.00	1Y	0.0700	-2.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-18.50	0.50		
-84.75	-1.75	1.5Y	-0.0300	-1.50	1.3150	1.1600	2*3Y	0.50	0.00		
-93.00	-2.00	2Y	-0.1150	-1.50	1.2450	1.1000	2*5Y	1.50	-0.50		
-92.50	-2.00	3Y	-0.1100	-1.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	-0.50	0.00		
-94.50	-1.75	4Y	-0.1150	-1.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	1.00	-0.50		
-94.00	-2.00	5Y	-0.1000	-2.00	1.1950	-0.4100	4*5Y	1.50	-0.50		
-82.75	-1.75	7Y	0.0200	-2.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-74.00	-1.75	10Y	0.1550	-2.00	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	0.1835	0.0001	0.1834	0.1737	0.1737	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6867	-0.0139	0.7006	0.6607	0.6607	2.7856	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	-63.65	0.01	-63.66	-62.63	-63.33	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-64.43	-0.79	-63.64	-65.13	-67.93	83.44	-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	8.00	-0.75	8.75	8.50	9.75	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	51.10	-0.60	51.70	51.20	53.30	61.40	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	50.32	-1.40	51.72	48.70	48.70	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	2y USIRS 26.4						
06M			9y 88						
09M									
01Y									
1.5Y	81.5								
02Y		SPRD	1*2y -2						
03Y									
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	4y CRS -13 / -14 / -12 4*5y CRS 2								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	78 건	-45	123	58	94	119	85	57	
금 액	35,210 억원	-25,625	60,835	18,545	23,363	42,466	27,108	15,977	

장중동향
국고채 금리. 채권시장은 오후장 중반까지 대체로 강세를 보이다가 다음 날 열리는 금융통화위원회를 앞두고 이익실현 움직임이 나타나며 금리 하락폭을 반납한 뒤 마감. 조원제 금융통화위원의 금통위 제책 가능성은 금리 동결 전망을 강화하는 요인으로 작용하며 국고채 금리 상승.

IRS. 중단기 구간을 중심으로 상승. 레벨도 적당하고 금통위를 앞둔 헤지 수요도 있어 3년 이하에서는 본드스왑 움직임이 있었으나 3년을 넘어서는 구간에서는 본드스왑 영향이 닿지 못했고, 이에 따라 IRS 금리는 3년이 가장 많이 상승.

CRS. 전 구간 하락. 마감