

IPS Daily Morning Brief

2020-05-29

종가 기준일 2020-05-28

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7950	-12.00	0.8870	0.9183	1.0173	1.9125	0.7950	1.9125	0.7950
9M	0.7700	-9.00	0.8360	0.8658	0.9698	1.8950	0.7700	1.9125	0.7700
1Y	0.7700	-6.00	0.8110	0.8328	0.9344	1.8800	0.7700	1.9200	0.7700
1.5Y	0.7725	-4.50	0.7995	0.8233	0.9268	1.8650	0.7725	2.0250	0.7725
2Y	0.7800	-3.50	0.7940	0.8184	0.9236	1.8425	0.7725	2.1150	0.7725
3Y	0.8025	-1.25	0.8000	0.8326	0.9355	1.8125	0.7850	2.2225	0.7850
4Y	0.8225	-0.75	0.8175	0.8558	0.9624	1.8000	0.8025	2.2950	0.8025
5Y	0.8450	0.50	0.8310	0.8719	0.9772	1.7975	0.8125	2.3400	0.8125
7Y	0.8575	1.00	0.8405	0.8830	0.9805	1.8100	0.8200	2.3950	0.8200
10Y	0.9075	1.25	0.8895	0.9320	1.0219	1.8600	0.8700	2.4850	0.8700
12Y	0.9175	1.25	0.8995	0.9381	1.0044	1.8850	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9175	1.25	0.8995	0.9221	0.9628	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7575	1.25	0.7395	0.7624	0.8105	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-2.50	3.00	-5.10	-5.25	-4.75	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.00	3.00	-2.50	-3.30	-3.54	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	1.00	2.50	-1.70	-1.44	-1.08	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.25	2.25	0.60	1.43	1.18	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	4.25	2.75	2.35	3.74	3.88	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	6.50	4.00	3.70	5.35	5.35	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.00	0.50	1.75	2.31	2.69	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	4.25	1.75	3.10	3.93	4.17	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.25	1.25	1.35	1.61	1.48	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	1.25	0.50	0.95	1.11	0.33	1.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	6.25	0.75	5.85	6.01	4.48	7.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	0.25	4.90	4.90	4.14	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	1.00	0.00	1.00	0.61	-1.75	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	1.00	0.00	1.00	-0.99	-5.91	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-15.00	0.00	-15.00	-16.96	-21.14	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.618	-5.20	0.665	0.716	0.871	1.918	0.618	1.935	0.618
1.5Y	0.725	-3.90	0.757	0.801	0.932	1.932	0.725	2.113	0.725
2Y	0.775	-4.50	0.804	0.860	0.978	1.944	0.775	2.230	0.775
3Y	0.817	-3.30	0.831	0.893	0.987	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	0.995	-1.00	0.990	1.055	1.166	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.085	0.20	1.074	1.143	1.222	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.207	1.00	1.194	1.267	1.345	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.350	1.90	1.334	1.410	1.466	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.465	1.80	1.460	1.527	1.558	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비	국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
91d CD	0.81	-21.00	KTb	112.12	0.02	112.10	112.39	112.09
CALL	0.48	-25.00	LKTB	133.96	-0.29	134.30	135.49	133.86

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	15.20	-0.80	14.60	11.73	6.32	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	4.75	-0.60	4.29	2.27	-0.55	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	0.50	1.00	-1.04	-4.16	-5.46	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-1.45	2.05	-3.06	-6.03	-5.20	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-17.25	0.25	-17.29	-19.94	-20.38	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-24.00	0.30	-24.30	-27.09	-24.51	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-34.95	0.00	-35.33	-38.36	-36.43	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-44.25	-0.65	-44.45	-47.77	-44.44	-12.25	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-70.75	-0.55	-72.03	-76.50	-74.80	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS		USD/KRW				1239.60 (+5.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-72.50	3.50	1Y	0.0450	-2.50	1.3900	-1.4500	1*2Y	-15.00	3.50
-80.75	4.00	1.5Y	-0.0350	-0.50	1.3150	1.1600	2*3Y	0.00	-0.50
-88.50	4.50	2Y	-0.1050	1.00	1.2450	1.0900	2*5Y	1.00	-0.50
-90.75	1.75	3Y	-0.1050	0.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	-0.50	0.00
-93.25	1.25	4Y	-0.1100	0.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	1.00	0.00
-94.00	0.00	5Y	-0.0950	0.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	1.50	0.00
-83.25	-0.50	7Y	0.0250	0.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00
-74.75	-0.75	10Y	0.1600	0.50	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	0.1562	-0.0273	0.1835	0.1834	0.1737	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6949	0.0082	0.6867	0.7006	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	-61.88	1.77	-63.65	-63.66	-62.63	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-65.51	-1.08	-64.43	-63.64	-65.13	78.71	-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	12.75	4.75	8.00	8.75	8.50	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	57.50	6.40	51.10	51.70	51.20	61.40	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	53.87	3.55	50.32	51.72	48.70	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	77								
1.5Y	77								
02Y	72 / 76.5	SPRD	4*5y 2						
03Y	79.75		5*10y 6						
04Y									
05Y	83 / 83.5 / 84.75 / 85 / 84.5								
07Y	83								
10Y	87.5 / 91 / 90								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y CRS -12 / -11 / -10								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	99 건	21	78	123	58	94	119	85	
금 액	26,056 억원	-9,154	35,210	60,835	18,545	23,363	42,466	27,108	

장중동향
 국고채 금리. 한국은행 금융통화위원회가 기준금리를 0.5%로 25bp 인하했지만, 단순매입과 관련한 새로운 소식이 없자 장기물 금리는 상승 전환하며 국고채 금리 수익률 곡선이 가팔라짐. 커브 스티프닝.

IRS. 한국은행의 기준금리 인하 조치에 단기 금리가 하락했고, 국고채를 따라 장기 구간 금리는 상승.

CRS. 1년물을 제외한 나머지 구간 모두 상승. 마감