

IPS Daily Morning Brief

2020-06-01

종가 기준일 2020-05-29

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7525	-4.25	0.8570	0.9065	1.0085	1.9050	0.7525	1.9125	0.7525
9M	0.7300	-4.00	0.8135	0.8549	0.9616	1.8925	0.7300	1.9125	0.7300
1Y	0.7250	-4.50	0.7940	0.8231	0.9267	1.8800	0.7250	1.9200	0.7250
1.5Y	0.7300	-4.25	0.7865	0.8139	0.9200	1.8650	0.7300	2.0250	0.7300
2Y	0.7375	-4.25	0.7855	0.8094	0.9178	1.8425	0.7375	2.1150	0.7375
3Y	0.7700	-3.25	0.7970	0.8239	0.9308	1.8125	0.7700	2.2225	0.7700
4Y	0.7900	-3.25	0.8150	0.8464	0.9583	1.8000	0.7900	2.2950	0.7900
5Y	0.8150	-3.00	0.8305	0.8624	0.9737	1.7975	0.8125	2.3400	0.8125
7Y	0.8200	-3.75	0.8390	0.8731	0.9773	1.8100	0.8200	2.3950	0.8200
10Y	0.8600	-4.75	0.8860	0.9216	1.0189	1.8600	0.8600	2.4850	0.8600
12Y	0.8725	-4.50	0.8965	0.9283	1.0014	1.8850	0.8725	2.5225	0.8725
15Y	0.8725	-4.50	0.8965	0.9143	0.9602	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7100	-4.75	0.7360	0.7535	0.8073	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-2.25	0.25	-4.35	-5.16	-4.69	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-0.50	-0.50	-1.95	-3.18	-3.49	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	1.25	0.25	-0.85	-1.38	-0.89	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	3.25	1.00	1.15	1.45	1.30	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	5.25	1.00	2.95	3.70	4.05	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.75	1.25	4.50	5.30	5.58	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.00	0.00	1.80	2.25	2.75	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	4.50	0.25	3.35	3.85	4.28	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.50	0.25	1.55	1.60	1.54	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.50	-0.75	0.85	1.08	0.36	1.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	4.50	-1.75	5.55	5.93	4.53	7.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.00	-1.00	4.70	4.85	4.17	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	1.25	0.25	1.05	0.66	-1.75	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	1.25	0.25	1.05	-0.74	-5.88	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-15.00	0.00	-15.00	-16.81	-21.16	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.593	-2.50	0.646	0.705	0.862	1.918	0.593	1.935	0.593
1.5Y	0.693	-3.20	0.742	0.791	0.925	1.932	0.693	2.113	0.693
2Y	0.747	-2.80	0.792	0.849	0.972	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.809	-0.80	0.826	0.882	0.982	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	0.987	-0.80	0.991	1.045	1.163	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.090	0.50	1.078	1.133	1.220	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.217	1.00	1.198	1.257	1.343	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.365	1.50	1.339	1.400	1.466	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.487	2.20	1.463	1.518	1.560	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.81	0.00
CALL	0.49	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	112.15	0.03	112.14	112.24	112.07
LKTB	133.82	-0.14	133.96	134.36	133.60

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	13.20	-2.00	14.76	11.78	6.49	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	3.70	-1.05	4.47	2.31	-0.49	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	-0.95	-1.45	-0.69	-3.95	-5.41	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-3.90	-2.45	-2.90	-5.80	-5.14	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-19.70	-2.45	-17.58	-19.81	-20.47	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-27.50	-3.50	-24.75	-27.06	-24.66	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-39.70	-4.75	-35.94	-38.37	-36.59	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-50.50	-6.25	-45.30	-47.87	-44.73	-12.25	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-77.70	-6.95	-72.72	-76.44	-75.22	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS		USD/KRW				1238.50 (-1.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
-70.50	2.00	1Y	0.0200	-2.50	1.3900	-1.4500	1*2Y	-15.00	0.00
-79.00	1.75	1.5Y	-0.0600	-2.50	1.3150	1.1600	2*3Y	0.00	0.00
-86.75	1.75	2Y	-0.1300	-2.50	1.2450	1.0900	2*5Y	0.00	-1.00
-90.00	0.75	3Y	-0.1300	-2.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	-0.50	0.00
-92.50	0.75	4Y	-0.1350	-2.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	0.00	-1.00
-94.50	-0.50	5Y	-0.1300	-3.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	0.50	-1.00
-83.00	0.25	7Y	-0.0100	-3.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00
-73.50	1.25	10Y	0.1250	-3.50	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	0.1603	0.0041	0.1562	0.1835	0.1834	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6591	-0.0358	0.6949	0.6867	0.7006	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	-58.67	3.21	-61.88	-63.65	-63.66	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-70.59	-5.08	-65.51	-64.43	-63.64	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	12.25	-0.50	12.75	8.00	8.75	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	61.80	4.30	57.50	51.10	51.70	61.80	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	49.88	-3.99	53.87	50.32	51.72	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M	75.25								
01Y	73.5								
1.5Y									
02Y	77.5	SPRD	5*10y 5.25						
03Y	79								
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	3y crs -13 1*3y crs -15								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	149 건	50	99	78	123	58	94	119	
금 액	58,547 억원	32,491	26,056	35,210	60,835	18,545	23,363	42,466	

장중동향
국고채 금리. 서울 채권시장은 외국인의 차익실현성 대규모 3년 국채선물 매도와 함께 다음 주에 있을 국고채 입찰 부담과 3차 추가경정예산 경계감이 악세 요인으로 작용해 금리가 상승마감 .

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

CRS. 1년물을 제외한 나머지 구간 모두 상승. 마감