

IPS Daily Morning Brief

2020-06-04

종가 기준일 2020-06-03

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7675	2.75	0.7595	0.8758	0.9842	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7450	2.75	0.7370	0.8265	0.9396	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7400	3.00	0.7320	0.7983	0.9071	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7550	3.50	0.7405	0.7923	0.9034	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.7750	4.50	0.7520	0.7904	0.9042	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8175	5.75	0.7835	0.8069	0.9203	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8425	6.00	0.8055	0.8286	0.9490	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8650	6.50	0.8280	0.8446	0.9657	1.7975	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.8900	7.50	0.8425	0.8560	0.9703	1.8100	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9325	8.00	0.8845	0.9030	1.0125	1.8600	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9425	8.00	0.8955	0.9109	0.9950	1.8850	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9425	8.00	0.8955	0.9029	0.9550	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7775	8.00	0.7325	0.7389	0.8007	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-2.25	0.00	-2.25	-4.93	-4.46	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-0.50	0.25	-0.50	-2.83	-3.25	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	3.50	1.50	2.00	-0.79	-0.29	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	4.25	1.25	3.15	1.65	1.62	4.25	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	6.75	1.50	5.35	3.83	4.48	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	9.00	2.00	7.60	5.43	6.15	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.50	0.25	2.20	2.18	2.86	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	4.75	0.75	4.45	3.78	4.53	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.25	0.50	2.25	1.60	1.67	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.50	1.00	1.45	1.14	0.47	2.50	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	6.75	1.50	5.65	5.84	4.68	6.75	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.25	0.50	4.20	4.70	4.22	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	1.00	0.00	1.10	0.79	-1.75	2.75	-9.50	9.50	-9.50
10*15Y	1.00	0.00	1.10	-0.01	-5.75	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-15.50	0.00	-15.20	-16.41	-21.18	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.636	3.70	0.607	0.679	0.837	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.730	3.40	0.707	0.768	0.906	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.765	0.50	0.761	0.824	0.956	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.865	3.50	0.831	0.861	0.971	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	1.037	4.20	1.006	1.025	1.158	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.151	5.10	1.110	1.117	1.218	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.272	5.50	1.233	1.240	1.342	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.417	6.00	1.378	1.383	1.469	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.537	3.00	1.505	1.502	1.565	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.81	0.00
CALL	0.47	0.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.99	-0.14	112.10	112.12	111.98
LKTb	133.23	-0.72	133.89	134.03	133.06

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	10.40	-0.70	12.52	11.98	6.98	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	2.50	0.10	3.35	2.45	-0.25	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	1.00	4.00	-0.94	-3.34	-5.21	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-4.75	2.25	-4.77	-5.46	-5.07	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-19.45	1.80	-20.03	-19.67	-20.87	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-28.60	1.40	-28.20	-27.26	-25.27	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-38.20	2.00	-39.05	-38.35	-37.13	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-48.45	2.00	-49.37	-47.98	-45.62	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-75.95	5.00	-77.27	-76.35	-76.40	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1216.80 (-8.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-76.00	-5.00	1Y	-0.0200	-2.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-13.50	0.50		
-83.50	-5.50	1.5Y	-0.0800	-2.00	1.3150	1.1650	2*3Y	0.00	-0.50		
-93.00	-6.00	2Y	-0.1550	-1.50	1.2450	1.0600	2*5Y	6.50	3.00		
-97.25	-7.75	3Y	-0.1550	-2.00	1.2150	-0.5650	3*4Y	1.50	1.50		
-98.25	-6.50	4Y	-0.1400	-0.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	6.50	3.50		
-95.50	-5.00	5Y	-0.0900	1.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	5.00	2.00		
-86.00	-6.00	7Y	0.0300	1.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-76.75	-6.50	10Y	0.1650	1.50	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	0.1998	0.0355	0.1643	0.1564	0.1603	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.7450	0.0598	0.6852	0.6599	0.6591	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	-56.52	3.05	-59.57	-60.36	-58.67	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-67.20	-0.02	-67.18	-74.21	-70.59	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	15.75	3.50	12.25	13.25	12.25	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	65.20	5.50	59.70	64.20	61.80	65.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	54.52	2.43	52.09	50.35	49.88	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	74 / 73.5 / 73.75								
1.5Y	75.25								
02Y	76.75	SPRD	1*1.5y 1.5						
03Y			4*12y 9						
04Y	79.5								
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	1.5y CCS -10								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	84 건	-20	104	128	149	99	78	123	
금 액	25,449 억원	-4,423	29,872	41,875	58,547	26,056	35,210	60,835	

장중동향
 국고채 금리. 외국인이 국채선물을 대거 순매도하면서 약세 압력을 주도, 이날 정부의 3차 추가경정예산 발표와 국채 매입 요청이 많았지만, 한국은행이 매입과 관련한 기존 입장을 유지한 채 별다른 신호를 주지 않은 점도 투자심리악화로 이어지며 국고채 금리 상승.

IRS. 전 구간 상승. 국고채 약세에 연동하는 모습이었고, 단기구간은 그동안 강세를 보이다가 최근들어 약세로 전환하면서 증권사 등에서 급하게 비드 물량이 나오는 모습을 보임.

CRS. 단기구간은 하락했고, 중장기 구간에서는 상승. 마감