

IPS Daily Morning Brief

2020-06-05

종가 기준일 2020-06-04

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7650	-0.25	0.7535	0.8678	0.9762	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7475	0.25	0.7325	0.8201	0.9325	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7525	1.25	0.7285	0.7940	0.9010	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7825	2.75	0.7425	0.7900	0.8985	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.8075	3.25	0.7575	0.7898	0.9003	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8475	3.00	0.7925	0.8069	0.9178	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8775	3.50	0.8165	0.8288	0.9469	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.9075	4.25	0.8405	0.8454	0.9643	1.7975	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.9325	4.25	0.8575	0.8571	0.9694	1.8100	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9750	4.25	0.8980	0.9038	1.0118	1.8600	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9850	4.25	0.9090	0.9120	0.9943	1.8850	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9850	4.25	0.9090	0.9060	0.9547	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8200	4.25	0.7450	0.7409	0.8000	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-1.75	0.50	-2.10	-4.76	-4.38	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.50	1.00	-0.40	-2.61	-3.15	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	5.50	2.00	2.90	-0.42	-0.07	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	4.00	-0.25	3.50	1.71	1.74	4.25	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	7.00	0.25	5.90	3.90	4.66	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	10.00	1.00	8.30	5.56	6.39	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.00	0.50	2.40	2.19	2.92	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	6.00	1.25	4.80	3.85	4.65	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	3.00	0.75	2.40	1.66	1.73	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.50	0.00	1.70	1.18	0.51	2.50	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	6.75	0.00	5.75	5.84	4.75	6.75	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.25	0.00	4.05	4.66	4.24	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	1.00	0.00	1.10	0.83	-1.75	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	1.00	0.00	1.10	0.23	-5.70	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-15.50	0.00	-15.30	-16.29	-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	0.656	2.00	0.614	0.674	0.830	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.746	1.60	0.711	0.764	0.901	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.792	2.70	0.765	0.818	0.952	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.885	2.00	0.845	0.859	0.968	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	1.055	1.80	1.018	1.022	1.156	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.175	2.40	1.128	1.116	1.218	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.288	1.60	1.249	1.237	1.341	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.427	1.00	1.394	1.381	1.470	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.537	0.00	1.520	1.500	1.567	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.80	-1.00
CALL	0.46	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.93	-0.06	111.96	112.06	111.88
LKTb	133.15	-0.08	133.08	133.48	132.95

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	9.65	-0.75	11.41	12.05	7.06	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	3.65	1.15	3.13	2.65	-0.21	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	1.55	0.55	-0.73	-2.86	-5.13	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-3.75	1.00	-5.23	-5.21	-5.01	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-17.75	1.70	-20.13	-19.37	-20.95	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-26.75	1.85	-28.75	-27.04	-25.41	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-35.55	2.65	-39.17	-38.03	-37.21	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-45.20	3.25	-49.56	-47.69	-45.79	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-71.70	4.25	-77.46	-75.91	-76.66	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1218.70 (+1.90)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-75.75	0.25	1Y	-0.0050	1.50	1.3900	-1.4500	1*2Y	-12.50	1.00		
-84.75	-1.25	1.5Y	-0.0650	1.50	1.3150	1.1650	2*3Y	0.00	0.00		
-93.75	-0.75	2Y	-0.1300	2.50	1.2450	1.0600	2*5Y	6.50	0.00		
-97.75	-0.50	3Y	-0.1300	2.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	1.50	0.00		
-99.25	-1.00	4Y	-0.1150	2.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	6.50	0.00		
-97.25	-1.75	5Y	-0.0650	2.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	5.00	0.00		
-87.75	-1.75	7Y	0.0550	2.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-78.50	-1.75	10Y	0.1900	2.50	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	0.2039	0.0041	0.1998	0.1643	0.1564	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.8276	0.0826	0.7450	0.6852	0.6599	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	-58.81	-2.29	-56.52	-59.57	-60.36	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-59.94	7.26	-67.20	-67.18	-74.21	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	16.75	1.00	15.75	12.25	13.25	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	63.50	-1.70	65.20	59.70	64.20	65.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	62.37	7.85	54.52	52.09	50.35	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	77 / 88								
03Y		SPRD							
04Y									
05Y	90.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	73 건	-11	84	104	128	149	99	78	
금 액	18,425 억원	-7,024	25,449	29,872	41,875	58,547	26,056	35,210	

장중동향
국고채 금리. 전 구간 상승. 채권시장은 약세로 출발해 오전 중 강세 시도했지만 오후 들어 개인의 3년 국채 선물 매수세에도 외국인의 선물 매도에도 막히며 약세로 전환한 뒤 마감.

IRS. 전 구간 상승. 국채선물과 마찬가지로 외국인이 매도하는 모습이었으며, 시장 분위기를 살피려는 심리에 적게 거래가 이루어진 가운데 금리는 상승.

CRS. 전 구간 상승. 마감