IPS Daily Morning Brief

2020-06-03

종가 기준일 2020-06-02

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7400	-0.25	0.7890	0.8844	0.9921	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7175	-0.50	0.7600	0.8344	0.9466	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7100	-0.50	0.7500	0.8049	0.9132	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7200	-0.50	0.7530	0.7975	0.9084	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.7300	-0.75	0.7600	0.7944	0.9081	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.7600	-0.75	0.7830	0.8098	0.9231	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.7825	-0.75	0.8030	0.8318	0.9513	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8000	-1.50	0.8230	0.8476	0.9676	1.7975	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.8150	-1.50	0.8340	0.8586	0.9718	1.8100	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.8525	-1.75	0.8770	0.9060	1.0138	1.8600	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.8625	-2.00	0.8880	0.9135	0.9963	1.8850	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.8625	-2.00	0.8880	0.9035	0.9558	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.6975	-2.25	0.7260	0.7406	0.8019	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975
6*9M	-2.25	-0.25	-2.90	-5.00	-4.55	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-0.75	0.00	-1.00	-2.95	-3.34	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	2.00	-0.25	1.00	-1.05	-0.51	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	3.00	0.00	2.30	1.54	1.50	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	5.25	0.00	4.30	3.74	4.32	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.00	-0.75	6.30	5.33	5.95	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.25	0.00	2.00	2.20	2.82	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	4.00	-0.75	4.00	3.79	4.45	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.75	-0.75	2.00	1.59	1.63	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	1.50	0.00	1.10	1.10	0.42	1.75	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	5.25	-0.25	5.40	5.84	4.62	7.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	3.75	-0.25	4.30	4.74	4.20	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	1.00	-0.25	1.10	0.75	-1.75	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	1.00	-0.25	1.10	-0.25	-5.80	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-15.50	-0.50	-15.10	-16.54	-21.19	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.599	1.10	0.614	0.685	0.845	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.696	0.50	0.714	0.774	0.911	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.760	0.00	0.772	0.831	0.961	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.830	-0.50	0.828	0.866	0.974	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	0.995	-2.00	0.999	1.030	1.159	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.100	-2.40	1.096	1.121	1.218	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.217	-3.50	1.218	1.244	1.342	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.357	-4.50	1.361	1.388	1.468	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.507	-2.30	1.487	1.507	1.563	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.81	0.00
CALL	0.47	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	112.13	0.05	112.10	112.13	111.98
LKTB	133.95	0.56	133.39	133.95	133.11

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	11.10	-1.60	13.64	11.94	6.86	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	2.40	-1.00	3.92	2.39	-0.30	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	-3.00	-0.75	-1.24	-3.69	-5.30	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-7.00	-0.25	-4.52	-5.63	-5.09	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-21.25	1.25	-19.64	-19.86	-20.76	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-30.00	0.90	-27.34	-27.36	-25.08	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-40.20	2.00	-38.40	-38.55	-36.99	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-50.45	2.75	-48.40	-48.17	-45.37	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-80.95	0.05	-76.12	-76.67	-76.08	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-71.00	-4.00
-78.00	-4.00
-87.00	-3.75
-89.50	-3.25
-91.75	-2.75
-90.50	1.00
-80.00	1.00
-70.25	1.25

CRS

USD/KRW 1225.40 (+0.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.0000	-4.50	1.3900	-1.4500	1*2Y	-14.00	0.00
1.5Y	-0.0600	-4.50	1.3150	1.1600	2*3Y	0.50	0.50
2Y	-0.1400	-4.50	1.2450	1.0600	2*5Y	3.50	4.00
3Y	-0.1350	-4.00	1.2150	-0.5650	3*4Y	0.00	0.50
4Y	-0.1350	-3.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	3.00	3.50
5Y	-0.1050	-0.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	3.00	3.00
7Y	0.0150	-0.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00
10Y	0.1500	-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	0.1643	0.0079	0.1564	0.1603	0.1562	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6852	0.0253	0.6599	0.6591	0.6949	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	-59.57	0.79	-60.36	-58.67	-61.88	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-67.18	7.03	-74.21	-70.59	-65.51	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	-1.00	13.25	12.25	12.75	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	59.70	-4.50	64.20	61.80	57.50	64.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	52.09	1.74	50.35	49.88	53.87	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y	73.25	SPRD	2*3y 3.25
03Y			
04Y	80		
05Y	82.25		
07Y			
10Y	88 / 82.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	104 건	-24	128	149	99	78	123	58
금 액	29,872 억원	-12,003	41,875	58,547	26,056	35,210	60,835	18,545

장중동향

국고채 금리. 서울 채권시장은 국고채 30년물 입찰을 앞둔 헤지 물량 등의 영향으로 약세 출발했지만, 장 막판에 3차 추가경정예산 언급이 나오면서 장중 변동성이 확대되며 국고채 금리 혼조세. 국고 10년물 금리는 하락했지만 , 나머지 구간 금리는 상승 마감.

IRS. 전 구간 하락. 장 마지막 시간대에 하락하는 움직임을 나타냄. 다만 현물과 완전히 동일한 움직임은 아니었고, 오퍼 우위의 장세가 현물 시장과는 다소 괴리되어 움직임.

CRS. 전 구간 하락. 마감