

IPS Daily Morning Brief

2020-06-09

종가 기준일 2020-06-08

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7650	0.50	0.7595	0.8521	0.9601	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7500	0.75	0.7405	0.8085	0.9186	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7550	0.50	0.7415	0.7869	0.8898	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7800	0.50	0.7625	0.7864	0.8896	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.8050	0.75	0.7830	0.7890	0.8939	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8550	0.00	0.8270	0.8091	0.9146	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.9000	0.25	0.8600	0.8329	0.9457	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.9300	-0.50	0.8875	0.8519	0.9646	1.7975	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.9625	0.00	0.9125	0.8649	0.9710	1.8100	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	1.0125	0.50	0.9560	0.9113	1.0145	1.8600	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	1.0325	0.50	0.9700	0.9213	0.9982	1.8850	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	1.0325	0.50	0.9700	0.9193	0.9595	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8650	0.50	0.8040	0.7516	0.8043	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-1.50	0.25	-1.90	-4.36	-4.15	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.50	-0.25	0.10	-2.16	-2.89	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	5.00	0.25	4.15	0.21	0.41	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	5.00	-0.75	4.40	2.01	2.07	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	9.50	-0.50	7.70	4.39	5.18	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	12.50	-1.25	10.45	6.29	7.07	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	4.50	0.25	3.30	2.38	3.11	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	7.50	-0.50	6.05	4.28	5.00	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	3.00	-0.75	2.75	1.90	1.89	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	3.25	0.50	2.50	1.30	0.65	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	8.25	1.00	6.85	5.94	4.99	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	0.50	4.35	4.64	4.34	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	1.40	1.00	-1.63	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	1.40	0.80	-5.50	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-14.75	0.00	-15.20	-15.96	-21.01	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.669	0.20	0.645	0.667	0.818	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.755	0.30	0.736	0.757	0.891	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.797	0.30	0.782	0.809	0.943	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.897	0.00	0.875	0.857	0.979	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	1.060	-1.10	1.044	1.020	1.155	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.185	-1.50	1.162	1.117	1.220	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.303	-1.30	1.279	1.238	1.343	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.447	-1.30	1.422	1.381	1.474	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.557	-0.80	1.541	1.501	1.574	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.79	0.00
CALL	0.46	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.90	0.00	111.87	111.97	111.87
LKTB	132.90	0.09	132.60	133.29	132.55

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	8.60	0.30	9.61	11.99	7.21	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	2.50	0.20	2.67	2.94	-0.11	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	0.80	0.45	0.14	-2.00	-4.90	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-4.20	0.00	-4.78	-4.75	-6.47	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-16.00	1.35	-18.36	-18.70	-20.89	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-25.50	1.00	-27.47	-26.54	-25.53	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-34.05	1.30	-36.67	-37.33	-37.20	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-43.45	1.80	-46.56	-47.00	-46.00	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-69.20	1.30	-73.66	-74.93	-76.95	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1204.80 (-2.30)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-72.00	1.00	1Y	0.0350	1.50	1.3900	-1.4500	1*2Y	-10.50	2.00		
-79.50	2.00	1.5Y	-0.0150	2.50	1.3150	1.1650	2*3Y	0.00	0.00		
-87.50	2.75	2Y	-0.0700	3.50	1.2450	1.0600	2*5Y	7.00	0.50		
-92.50	3.50	3Y	-0.0700	3.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	1.50	0.00		
-95.50	3.25	4Y	-0.0550	3.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	7.00	0.50		
-93.00	4.50	5Y	0.0000	4.00	1.1950	-0.4100	4*5Y	5.50	0.50		
-84.25	4.00	7Y	0.1200	4.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-75.75	3.50	10Y	0.2550	4.00	1.4000	-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	0.2281	0.0160	0.2121	0.2039	0.1998	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.8819	-0.0199	0.9018	0.8276	0.7450	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	-56.89	1.3	-58.19	-58.81	-56.52	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-56.51	-0.69	-55.82	-59.94	-67.20	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	20.75	-0.25	21.00	16.75	15.75	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	65.00	-1.60	66.60	63.50	65.20	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	65.38	-3.59	68.97	62.37	54.52	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	75.25								
1.5Y									
02Y	79 / 80 / 81.25								
03Y	86		SPRD						
04Y	89.25 / 89								
05Y	92								
07Y									
10Y	0								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	4y ccs -7								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	58 건	-115	173	73	84	104	128	149	
금 액	11,633 억원	-28,870	40,503	18,425	25,449	29,872	41,875	58,547	

장중동향

국고채 금리. 외국인의 집중적인 국채선물 순매수에도 기관 매도 등에 막히며 약보합 마감.

IRS. 큰 폭의 움직임 없이 국고채 시장에 연동해 움직이며 단기 구간 위주로 상승. 외국인이 장중 국채 10년 선물을 많이 매수하는 흐름을 보였고, IRS금리도 함께 강해졌다가 이후 낙폭을 되돌림. 전반적으로 IRS시장 자체의 움직임은 크지 않았음.

CRS. 전 구간 상승 . 마감