IPS Daily Morning Brief

2020-06-10

종가 기준일 2020-06-09

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7675	0.25	0.7650	0.8453	0.9520	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7575	0.75	0.7485	0.8040	0.9116	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7600	0.50	0.7515	0.7844	0.8839	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7775	-0.25	0.7740	0.7855	0.8847	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.7925	-1.25	0.7955	0.7891	0.8898	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8250	-3.00	0.8400	0.8098	0.9118	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8650	-3.50	0.8765	0.8344	0.9436	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8850	-4.50	0.9045	0.8538	0.9630	1.7975	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.9100	-5.25	0.9315	0.8671	0.9701	1.8100	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9550	-5.75	0.9765	0.9133	1.0140	1.8600	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9750	-5.75	0.9925	0.9241	0.9983	1.8850	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9750	-5.75	0.9925	0.9241	0.9600	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8075	-5.75	0.8260	0.7553	0.8048	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-1.00	0.50	-1.65	-4.13	-4.04	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.25	-0.25	0.30	-1.96	-2.77	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	3.25	-1.75	4.40	0.48	0.59	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	3.25	-1.75	4.45	2.06	2.19	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	7.25	-2.25	8.10	4.53	5.38	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	9.25	-3.25	10.90	6.46	7.32	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	4.00	-0.50	3.65	2.46	3.19	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	6.00	-1.50	6.45	4.40	5.13	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.00	-1.00	2.80	1.94	1.94	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.50	-0.75	2.70	1.34	0.70	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	7.00	-1.25	7.20	5.95	5.10	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.50	-0.50	4.50	4.61	4.39	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	1.60	1.09	-1.57	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	1.60	1.09	-5.40	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-14.75	0.00	-15.05	-15.80	-20.93	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.661	-0.80	0.658	0.664	0.811	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.751	-0.40	0.747	0.754	0.886	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.777	-2.00	0.785	0.805	0.938	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.850	-4.70	0.879	0.855	0.976	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	1.001	-5.90	1.045	1.017	1.152	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.120	-6.50	1.166	1.116	1.219	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.238	-6.50	1.283	1.236	1.342	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.382	-6.50	1.427	1.379	1.475	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.507	-5.00	1.541	1.499	1.575	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.79	0.00
CALL	0.53	7.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	112.08	0.18	111.94	112.08	111.93
LKTB	133.65	0.75	133.11	133.65	133.05

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	9.90	1.30	9.37	12.02	7.26	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	2.65	0.15	2.72	3.12	-0.09	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	1.55	0.75	1.05	-1.58	-4.82	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-2.50	1.70	-3.88	-4.52	-6.38	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-13.60	2.40	-16.83	-18.26	-20.81	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-23.50	2.00	-26.17	-26.26	-25.58	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-32.80	1.25	-35.19	-36.92	-37.18	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-42.70	0.75	-45.01	-46.56	-46.07	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-69.95	-0.75	-71.46	-74.42	-77.07	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-76.00	-4.00
-82.75	-3.25
-89.75	-2.25
-93.00	-0.50
-95.00	0.50
-90.50	2.50
-81.00	3.25
-72.00	3.75

CRS

USD/KRW 1197.70 (-7.10)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.0000	-3.50	1.3900	-1.4500	1*2Y	-10.50	0.00
1.5Y	-0.0500	-3.50	1.3150	1.1650	2*3Y	0.00	0.00
2Y	-0.1050	-3.50	1.2450	1.0600	2*5Y	8.50	1.50
3Y	-0.1050	-3.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	2.00	0.50
4Y	-0.0850	-3.00	1.2000	-0.4750	3*5Y	8.50	1.50
5Y	-0.0200	-2.00	1.1950	-0.4100	4*5Y	6.50	1.00
7Y	0.1000	-2.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00
10Y	0.2350	-2.00	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	0.2124	-0.0157	0.2281	0.2121	0.2039	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.8287	-0.0532	0.8819	0.9018	0.8276	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	-56.46	0.43	-56.89	-58.19	-58.81	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-55.33	1.18	-56.51	-55.82	-59.94	77.48	-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	16.25	-4.50	20.75	21.00	16.75	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	60.50	-4.50	65.00	66.60	63.50	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	61.63	-3.75	65.38	68.97	62.37	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y		SPRD	10*15y -1
03Y	82.5		2*4y 7.5
04Y			
05Y	90 / 89		
07Y			
10Y	95.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	4y CCS -8		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	123 건	65	58	173	73	84	104	128
금 액	84,646 억원	73,013	11,633	40,503	18,425	25,449	29,872	41,875

장중동향

국고채 금리. 저가매수 유입과 지표물 변경 대기 등 요인에 강세(금리하락)를 보임.

IRS. 1년 이하 금리가 소폭 오른 가운데 장기 금리가 내리면서 수익률 곡선은 평탄해짐. (커브 플래트닝). 장기 금리가 많이 내렸지만, 단기는 1년 이하 구간에 비드가 많았음. 오전에 거래가 적었지만, 오후에 선물이 자리를 잡으면서 거래가 늘어나는 모습.

CRS. 전 구간 하락. 마감