

IPS Daily Morning Brief

2020-06-11

종가 기준일 2020-06-10

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7675	0.00	0.7650	0.8383	0.9442	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7575	0.00	0.7510	0.7998	0.9049	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7600	0.00	0.7555	0.7825	0.8784	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7800	0.25	0.7790	0.7855	0.8803	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.7925	0.00	0.7990	0.7901	0.8860	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8275	0.25	0.8420	0.8119	0.9088	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8600	-0.50	0.8800	0.8370	0.9412	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8800	-0.50	0.9075	0.8568	0.9609	1.7975	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.9050	-0.50	0.9345	0.8708	0.9685	1.8100	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9500	-0.50	0.9800	0.9169	1.0128	1.8600	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9700	-0.50	0.9980	0.9285	0.9990	1.8850	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9700	-0.50	0.9980	0.9285	0.9618	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7950	-1.25	0.8295	0.7601	0.8062	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-1.00	0.00	-1.40	-3.85	-3.93	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.25	0.00	0.45	-1.73	-2.65	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	3.25	0.00	4.35	0.76	0.76	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	3.50	0.25	4.30	2.18	2.28	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	6.75	-0.50	8.10	4.69	5.52	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	8.75	-0.50	10.85	6.66	7.48	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.25	-0.75	3.80	2.51	3.24	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	5.25	-0.75	6.55	4.49	5.21	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.00	0.00	2.75	1.98	1.97	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.50	0.00	2.70	1.40	0.76	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	7.00	0.00	7.25	6.01	5.19	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.50	0.00	4.55	4.61	4.43	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	1.80	1.16	-1.38	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	1.80	1.16	-5.10	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-15.50	-0.75	-15.05	-15.68	-20.66	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.652	-0.90	0.661	0.661	0.805	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.746	-0.50	0.750	0.752	0.880	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.775	-0.20	0.787	0.802	0.933	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.837	-1.30	0.873	0.854	0.972	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	0.997	-0.40	1.037	1.015	1.149	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.117	-0.30	1.159	1.116	1.218	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.256	1.80	1.280	1.237	1.341	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.385	0.30	1.420	1.378	1.475	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.517	1.00	1.537	1.500	1.577	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.79	0.00
CALL	0.48	-5.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	112.09	0.01	112.08	112.11	112.03
LKTb	133.59	-0.06	133.69	133.69	133.22

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	10.80	0.90	9.45	12.15	7.36	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	3.40	0.75	2.90	3.35	-0.02	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	1.75	0.20	1.20	-1.17	-4.73	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-0.95	1.55	-3.12	-4.19	-6.32	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-13.70	-0.10	-15.68	-17.81	-20.79	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-23.70	-0.20	-25.19	-25.97	-25.72	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-35.10	-2.30	-34.57	-36.63	-37.27	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-43.50	-0.80	-44.02	-46.16	-46.21	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-72.20	-2.25	-70.71	-74.02	-77.08	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1191.20 (-6.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-81.00	-5.00	1Y	-0.0500	-5.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-7.50	3.00		
-86.50	-3.75	1.5Y	-0.0850	-3.50	1.3150	1.1650	2*3Y	1.50	1.50		
-91.75	-2.00	2Y	-0.1250	-2.00	1.2450	1.0600	2*5Y	11.50	3.00		
-93.75	-0.75	3Y	-0.1100	-0.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	3.50	1.50		
-93.50	1.50	4Y	-0.0750	1.00	1.2000	-0.4750	3*5Y	10.00	1.50		
-89.00	1.50	5Y	-0.0100	1.00	1.1950	-0.4100	4*5Y	6.50	0.00		
-79.50	1.50	7Y	0.1100	1.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-70.50	1.50	10Y	0.2450	1.00	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	0.1806	-0.0318	0.2124	0.2281	0.2121	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.7247	-0.1040	0.8287	0.8819	0.9018	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	-59.44	-2.98	-56.46	-56.89	-58.19	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-66.03	-10.70	-55.33	-56.51	-55.82	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	15.75	-0.50	16.25	20.75	21.00	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	61.00	0.50	60.50	65.00	66.60	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	54.41	-7.22	61.63	65.38	68.97	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	78.75								
02Y		SPRD	1*1.5y 2						
03Y	84.75 / 84 / 83								
04Y	86								
05Y	89.75								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	92 건	-31	123	58	173	73	84	104	
금 액	30,101 억원	-54,545	84,646	11,633	40,503	18,425	25,449	29,872	

장중동향

국고채 금리, 미 연방공개시장위원회(FOMC)결과를 기다리는 가운데 재개된 외국인 매도세와 이에 맞선 기관의 매수세 사이에서 보험권이 머무름, 외인-기관 줄다리기.

IRS. 장기구간을 중심으로 소폭 하락해 수익률 곡선이 평탄해짐(커브 플래트닝). 5년물을 기준으로 이하 구간은 비디워했고, 이상 구간은 호가가 많이 없었으며 증권 등 국내 기관이 2년 이하에서 비드를 지속. 국채선물에 비해 움직임이 둔했고 특별한 동향은 없었음.

CRS. 전 구간 하락. 마감