IPS Daily Morning Brief

2020-06-12

종가 기준일 2020-06-11

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7675	0.00	0.7655	0.8303	0.9377	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7675	1.00	0.7550	0.7953	0.8997	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7675	0.75	0.7585	0.7803	0.8743	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7850	0.50	0.7795	0.7849	0.8763	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.7950	0.25	0.7965	0.7905	0.8822	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8300	0.25	0.8385	0.8138	0.9051	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8575	-0.25	0.8760	0.8393	0.9370	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8750	-0.50	0.9010	0.8593	0.9561	1.7975	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.9025	-0.25	0.9285	0.8743	0.9641	1.8100	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9500	0.00	0.9750	0.9205	1.0084	1.8600	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9700	0.00	0.9950	0.9329	0.9962	1.8850	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9700	0.00	0.9950	0.9329	0.9605	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7950	0.00	0.8245	0.7650	0.8048	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	0.00	1.00	-1.05	-3.50	-3.80	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.00	-0.25	0.35	-1.50	-2.54	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	2.75	-0.50	3.80	1.03	0.79	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	3.50	0.00	4.20	2.33	2.29	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	6.25	-0.50	7.95	4.88	5.48	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	8.00	-0.75	10.45	6.88	7.39	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.75	-0.50	3.75	2.55	3.19	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	4.50	-0.75	6.25	4.55	5.10	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.75	-0.25	2.50	2.00	1.91	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.75	0.25	2.75	1.50	0.80	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	7.50	0.50	7.40	6.13	5.23	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.75	0.25	4.65	4.63	4.43	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.24	-1.23	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	2.00	1.24	-4.80	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-15.50	0.00	-15.05	-15.55	-20.37	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	0.90	0.662	0.658	0.798	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.746	0.00	0.750	0.750	0.875	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.775	0.00	0.784	0.799	0.928	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.837	0.00	0.864	0.853	0.967	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	0.992	-0.50	1.024	1.013	1.144	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.112	-0.50	1.147	1.116	1.215	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.253	-0.30	1.273	1.238	1.337	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.382	-0.30	1.411	1.378	1.471	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.520	0.30	1.533	1.501	1.575	2.106	0.705	2.792	0.705

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	112.09	0.00	112.17	112.20	112.08
LKTB	133.60	0.01	134.00	134.15	133.56

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	10.65	-0.15	9.65	12.19	7.61	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	3.90	0.50	2.95	3.52	0.15	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	2.00	0.25	1.29	-0.82	-4.55	2.00	-12.95	2.00	-25.15
3Y	-0.70	0.25	-2.51	-3.89	-6.17	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-13.45	0.25	-14.82	-17.37	-20.70	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-23.70	0.00	-24.58	-25.70	-25.84	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-35.05	0.05	-34.47	-36.33	-37.33	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-43.20	0.30	-43.62	-45.75	-46.25	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-72.50	-0.30	-70.87	-73.65	-77.04	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-87.25	-6.25
-92.50	-6.00
-97.50	-5.75
-99.50	-5.75
-98.25	-4.75
-93.50	-4.50
-84.25	-4.75
-75.50	-5.00

CRS

USD/KRW 1196.40 (+5.20)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-0.1050	-5.50	1.3900	-1.4500	1*2Y	-7.50	0.00
1.5Y	-0.1400	-5.50	1.3150	1.1650	2*3Y	1.50	0.00
2Y	-0.1800	-5.50	1.2450	1.0600	2*5Y	12.00	0.50
3Y	-0.1650	-5.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	4.00	0.50
4Y	-0.1250	-5.00	1.2000	-0.4750	3*5Y	10.50	0.50
5Y	-0.0600	-5.00	1.1950	-0.4100	4*5Y	6.50	0.00
7Y	0.0600	-5.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00
10Y	0.1950	-5.00	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	0.2006	0.0200	0.1806	0.2124	0.2281	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6731	-0.0516	0.7247	0.8287	0.8819	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	-57.44	2	-59.44	-56.46	-56.89	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-70.89	-4.86	-66.03	-55.33	-56.51	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	15.50	-0.25	15.75	16.25	20.75	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	60.70	-0.30	61.00	60.50	65.00	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	47.25	-7.16	54.41	61.63	65.38	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	6y 85.75
06M			
09M	75.25		
01Y			
1.5Y			
02Y		SPRD	
03Y			
04Y			
05Y	85		
07Y			
10Y	92		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	66 건	-26	92	123	58	173	73	84
금 액	17,776 억원	-12,325	30,101	84,646	11,633	40,503	18,425	25,449

장중동향

국고채 금리. 미국 연방준비제도(Fed.연준)의 연방공개시장위원회(FOMC) 회의 결과 공개와 국내 주식시장 약세 등이 채권시장 강세 재료로 작용하며 국고채 금리 하락.

IRS. 보합권에서 혼조세를 보임. 국채선물 따라 장 변동성이 크게 나타나면서 손바뀜 물량이 많았으며 구간별로 증권사들이 5년 구간에서 비드를 많이 함. 단기쪽은 레포 규제를 앞둔 영향인지 약한 모을 보임.

CRS. 전 구간 하락. 마감