IPS Daily Morning Brief

2020-06-15

종가 기준일 2020-06-12

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7625	-0.50	0.7660	0.8221	0.9323	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7600	-0.75	0.7585	0.7901	0.8955	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7600	-0.75	0.7605	0.7771	0.8713	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7800	-0.50	0.7805	0.7834	0.8739	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.7875	-0.75	0.7945	0.7898	0.8797	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8175	-1.25	0.8310	0.8143	0.9026	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8425	-1.50	0.8650	0.8400	0.9341	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8575	-1.75	0.8855	0.8601	0.9530	1.7975	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.8825	-2.00	0.9125	0.8763	0.9614	1.8100	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9300	-2.00	0.9595	0.9226	1.0060	1.8600	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9500	-2.00	0.9795	0.9356	0.9956	1.8850	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9500	-2.00	0.9795	0.9356	0.9614	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7725	-2.25	0.8070	0.7679	0.8055	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975
6*9M	-0.25	-0.25	-0.75	-3.20	-3.67	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.00	0.00	0.20	-1.30	-2.43	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	2.75	0.00	3.40	1.26	0.84	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	3.00	-0.50	3.65	2.45	2.30	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	5.50	-0.75	7.05	5.03	5.45	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.00	-1.00	9.10	7.04	7.33	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.50	-0.25	3.40	2.58	3.15	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	4.00	-0.50	5.45	4.59	5.03	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.50	-0.25	2.05	2.01	1.88	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.50	-0.25	2.70	1.61	0.85	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	7.25	-0.25	7.40	6.25	5.30	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.75	0.00	4.70	4.64	4.46	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.30	-1.04	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	2.00	1.30	-4.46	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-15.75	-0.25	-15.25	-15.48	-20.05	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.676	1.50	0.664	0.657	0.793	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.756	1.00	0.751	0.748	0.871	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.782	0.70	0.781	0.796	0.924	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.841	0.40	0.852	0.851	0.963	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	1.005	1.30	1.011	1.012	1.141	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.121	0.90	1.131	1.117	1.213	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.257	0.40	1.261	1.239	1.335	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.380	-0.20	1.395	1.378	1.469	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.525	0.50	1.525	1.503	1.575	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.79	0.00
CALL	0.45	-3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	112.06	-0.03	112.11	112.14	112.05
LKTB	133.58	-0.02	133.75	133.96	133.47

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	8.40	-2.25	9.67	11.98	7.84	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	2.40	-1.50	2.97	3.49	0.33	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	0.55	-1.45	1.33	-0.60	-4.39	2.00	-12.95	2.00	-25.15
3Y	-2.35	-1.65	-2.14	-3.69	-6.05	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-16.25	-2.80	-14.60	-17.19	-20.66	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-26.35	-2.65	-24.55	-25.66	-25.97	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-37.45	-2.40	-34.89	-36.24	-37.40	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-45.00	-1.80	-43.57	-45.55	-46.27	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-75.25	-2.75	-71.82	-73.56	-76.94	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-97.50	-10.25
-103.00	-10.50
-107.75	-10.25
-105.25	-5.75
-102.25	-4.00
-98.25	-4.75
-88.75	-4.50
-80.00	-4.50

CRS

USD/KRW 1203.80 (+7.40)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-0.2150	-11.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-7.50	0.00
1.5Y	-0.2500	-11.00	1.3150	1.1650	2*3Y	5.50	4.00
2Y	-0.2900	-11.00	1.2450	1.0600	2*5Y	16.50	4.50
3Y	-0.2350	-7.00	1.2150	-0.5650	3*4Y	5.50	1.50
4Y	-0.1800	-5.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	11.00	0.50
5Y	-0.1250	-6.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	5.50	-1.00
7Y	-0.0050	-6.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00
10Y	0.1300	-6.50	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	0.2050	0.0044	0.2006	0.1806	0.2124	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.7043	0.0312	0.6731	0.7247	0.8287	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	-57.70	-0.26	-57.44	-59.44	-56.46	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-67.57	3.32	-70.89	-66.03	-55.33	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	14.25	-1.25	15.50	15.75	16.25	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	59.80	-0.90	60.70	61.00	60.50	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	49.93	2.68	47.25	54.41	61.63	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS		ODD Tenor	
06M	76		
09M			
01Y			
1.5Y			
02Y		SPRD	
03Y	82		
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	92.25		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS			

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	77 건	11	66	92	123	58	173	73
금 액	20,140 억원	2,364	17,776	30,101	84,646	11,633	40,503	18,425

장중동향

국고채 금리. 전일 미국 주가가 급락한 여파에도 국내 주식시장이 선전했고, 증권사 매도 물량이 몰리며 장 후반 약세로 전환해 마감. 전 구간 상승.

IRS. 전 구간 하락. 현물 대비 스와프 금리는 대외 금리 영향이 상대적으로 커 금리가 하락세를 나타냈으며 국채 현물과 선물에는 50년물과 10년물 입찰 경계감도 있고, 선물의 롤오버가 진행 중인 영향도 작용함.

CRS. 전 구간 하락. 마감