IPS Daily Morning Brief

2020-06-17

종가 기준일 2020-06-16

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7625	-0.25	0.7650	0.8066	0.9265	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7600	-0.50	0.7620	0.7801	0.8906	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7575	-0.75	0.7620	0.7704	0.8670	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7850	-0.25	0.7835	0.7794	0.8706	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.8025	0.00	0.7960	0.7875	0.8758	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8375	0.25	0.8295	0.8141	0.8987	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8600	0.00	0.8560	0.8399	0.9291	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8725	-0.25	0.8720	0.8596	0.9473	1.7975	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.8975	-0.25	0.8975	0.8776	0.9566	1.8100	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9475	0.00	0.9450	0.9240	1.0014	1.8600	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9675	0.00	0.9650	0.9383	0.9940	1.8850	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9675	0.00	0.9650	0.9383	0.9630	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7900	0.00	0.7885	0.7708	0.8070	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-0.25	-0.25	-0.30	-2.65	-3.59	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-0.25	-0.25	0.00	-0.98	-2.35	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	4.50	0.75	3.40	1.71	0.88	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	3.50	0.25	3.35	2.66	2.29	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	5.75	0.00	6.00	5.24	5.33	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.00	-0.25	7.60	7.21	7.15	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.25	-0.25	2.65	2.58	3.04	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	3.50	-0.50	4.25	4.55	4.86	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.25	-0.25	1.60	1.98	1.82	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.50	0.00	2.55	1.80	0.93	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	7.50	0.25	7.30	6.44	5.41	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	0.25	4.75	4.64	4.48	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.43	-0.74	2.75	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	2.00	1.43	-3.85	4.25	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-15.75	0.00	-15.65	-15.33	-19.44	3.25	-35.00	11.25	-35.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.701	0.00	0.678	0.658	0.787	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.793	1.40	0.764	0.749	0.866	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.800	-0.20	0.787	0.791	0.917	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.857	-1.00	0.848	0.849	0.957	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	1.020	-2.00	1.011	1.012	1.135	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.135	-2.20	1.128	1.118	1.210	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.276	-1.80	1.267	1.242	1.333	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.407	-1.50	1.395	1.380	1.467	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.555	-1.20	1.537	1.508	1.577	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.79	0.00
CALL	0.45	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	111.92	-0.03	111.91	111.98	111.86
LKTB	133.26	0.08	133.15	133.32	132.98

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	5.65	-0.75	8.38	11.21	8.01	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	-0.80	-1.65	1.95	3.05	0.50	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	0.25	0.20	0.92	-0.34	-4.14	2.00	-12.95	2.00	-25.15
3Y	-1.95	1.25	-1.83	-3.52	-5.87	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-16.00	2.00	-15.48	-17.24	-20.59	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-26.25	1.95	-25.64	-25.88	-26.28	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-37.85	1.55	-36.97	-36.45	-37.66	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-45.95	1.50	-45.02	-45.62	-46.54	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-76.50	1.20	-74.83	-73.76	-76.97	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-100.25	4.75
-106.00	4.75
-112.25	4.00
-109.25	4.75
-106.00	5.00
-101.25	5.75
-91.75	5.75
-83.25	5.50

CRS

USD/KRW 1207.20 (-8.80)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-0.2450	4.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-7.50	0.00
1.5Y	-0.2750	4.50	1.3150	1.1650	2*3Y	6.50	1.00
2Y	-0.3200	4.00	1.2450	1.0600	2*5Y	18.00	1.50
3Y	-0.2550	5.00	1.2150	-0.5650	3*4Y	5.50	0.00
4Y	-0.2000	5.00	1.2000	-0.4750	3*5Y	11.50	0.50
5Y	-0.1400	5.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	6.00	0.50
7Y	-0.0200	5.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00
10Y	0.1150	5.50	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	0.2172	0.0161	0.2011	0.2050	0.2006	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.7570	0.0272	0.7298	0.7043	0.6731	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	-58.28	1.81	-60.09	-57.70	-57.44	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-65.00	4.22	-69.22	-67.57	-70.89	77.36	-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	14.50	0.00	14.50	14.25	15.50	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	60.70	-1.30	62.00	59.80	60.70	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	53.98	1.11	52.87	49.93	47.25	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	78.5		
02Y	81 / 79.5 / 80	SPRD	
03Y	83.25		
04Y	85.5		
05Y			
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	1y CCS -23.5 / -22		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	107 건	50	57	77	66	92	123	58
금 액	28,225 억원	12,286	15,939	20,140	17,776	30,101	84,646	11,633

장중동향

국고채 금리. 장기물 중심으로 하락. 만기 선물 롤오버(월물교체)를 마친 외국인이 장중 국채선물 매수세를 확대한 영향으로 풀이됨.

IRS. 최근 오퍼 우위의 시장 분위기와는 다르게 오늘은 비드가 적극적으로 등장. 본드스와프가 축소되는 분위기로 단기 구간에서 하락.

CRS. 전 구간 상승. 마감