

IPS Daily Morning Brief

2020-06-18

종가 기준일 2020-06-17

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7650	0.25	0.7645	0.7995	0.9223	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7675	0.75	0.7640	0.7759	0.8864	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7700	1.25	0.7640	0.7679	0.8628	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7950	1.00	0.7865	0.7783	0.8663	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.8150	1.25	0.8005	0.7875	0.8712	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8525	1.50	0.8345	0.8154	0.8941	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8775	1.75	0.8595	0.8411	0.9240	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8925	2.00	0.8745	0.8606	0.9418	1.7975	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.9200	2.25	0.9005	0.8796	0.9517	1.8100	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9725	2.50	0.9495	0.9260	0.9968	1.8600	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9925	2.50	0.9695	0.9408	0.9908	1.8850	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9925	2.50	0.9695	0.9408	0.9613	1.9000	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8150	2.50	0.7925	0.7730	0.8055	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	0.25	0.50	-0.05	-2.36	-3.59	0.25	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.25	0.50	0.00	-0.80	-2.36	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	4.50	0.00	3.65	1.96	0.84	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	3.75	0.25	3.40	2.79	2.29	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	6.25	0.50	5.90	5.36	5.28	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.75	0.75	7.40	7.31	7.05	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.50	0.25	2.50	2.58	2.99	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	4.00	0.50	4.00	4.53	4.77	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.50	0.25	1.50	1.95	1.78	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.75	0.25	2.60	1.90	0.99	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	8.00	0.50	7.50	6.54	5.50	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.25	0.25	4.90	4.64	4.51	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.48	-0.60	2.75	-9.50	5.25	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	2.00	1.48	-3.55	4.25	-18.00	7.75	-18.00
10*20Y	-15.75	0.00	-15.70	-15.30	-19.13	3.25	-35.00	11.00	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.721	2.00	0.692	0.660	0.783	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.807	1.40	0.776	0.750	0.862	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.825	2.50	0.797	0.790	0.912	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.875	1.80	0.855	0.850	0.952	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	1.037	1.70	1.019	1.013	1.128	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.145	1.00	1.134	1.120	1.205	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.275	-0.10	1.271	1.245	1.328	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.397	-1.00	1.398	1.382	1.462	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.542	-1.30	1.542	1.511	1.574	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.79	0.00
CALL	0.46	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.86	-0.06	111.91	111.93	111.80
LKTb	133.28	0.02	133.15	133.38	132.81

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	4.90	-0.75	7.20	10.81	7.97	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	-1.20	-0.40	1.03	2.81	0.40	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	-1.00	-1.25	0.37	-0.28	-4.06	2.00	-12.95	2.00	-25.15
3Y	-2.25	-0.30	-2.09	-3.44	-5.79	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-15.95	0.05	-15.93	-17.22	-20.42	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-25.25	1.00	-25.95	-25.93	-26.31	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-35.50	2.35	-37.05	-36.50	-37.65	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-42.45	3.50	-44.81	-45.61	-46.55	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-72.70	3.80	-74.93	-73.81	-76.88	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1213.90 (+6.70)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-94.50	5.75	1Y	-0.1750	7.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-9.50	-2.00		
-101.00	5.00	1.5Y	-0.2150	6.00	1.3150	1.1650	2*3Y	6.00	-0.50		
-108.50	3.75	2Y	-0.2700	5.00	1.2450	1.0600	2*5Y	17.50	-0.50		
-106.25	3.00	3Y	-0.2100	4.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	5.50	0.00		
-103.25	2.75	4Y	-0.1550	4.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	11.50	0.00		
-98.75	2.50	5Y	-0.0950	4.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	6.00	0.00		
-89.50	2.25	7Y	0.0250	4.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-81.25	2.00	10Y	0.1600	4.50	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	0.1973	-0.0199	0.2172	0.2011	0.2050	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.7339	-0.0231	0.7570	0.7298	0.7043	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	-62.77	-4.49	-58.28	-60.09	-57.70	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-66.31	-1.31	-65.00	-69.22	-67.57	76.80	-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	1.25	14.50	14.50	14.25	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	57.20	-3.50	60.70	62.00	59.80	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	53.66	-0.32	53.98	52.87	49.93	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS					ODD Tenor				
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	80.25 / 81.25				SPRD				
03Y									
04Y									
05Y									
07Y									
10Y	97								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	100 건	-7	107	57	77	66	92	123	
금 액	44,459 억원	16,234	28,225	15,939	20,140	17,776	30,101	84,646	

장중동향
 국고채 금리. 한국은행 금융통화위원회 의사록과 이주열 총재의 인터뷰 발언 등이 매파적으로 해석되면서 단기 구간을 중심으로 약세 심화. 반기 말을 맞아 계절적 요인도 약세 분위기를 지지하며 국고채 금리 상승.

IRS. 전 구간 상승. 단기보다 장기금리가 더 올라 수익률 곡선은 가팔라짐. 커브스티프닝.

CRS. 전 구간 큰 폭 상승. 마감