

IPS Daily Morning Brief

2020-06-22

종가 기준일 2020-06-19

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7650	0.50	0.7635	0.7854	0.9150	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7700	0.75	0.7650	0.7680	0.8794	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7750	1.00	0.7665	0.7636	0.8560	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7925	0.75	0.7890	0.7769	0.8593	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.8050	0.75	0.8045	0.7885	0.8632	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8325	0.25	0.8375	0.8188	0.8863	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8625	1.25	0.8620	0.8450	0.9150	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8800	1.75	0.8765	0.8643	0.9322	1.7925	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.9075	2.00	0.9025	0.8850	0.9429	1.8000	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9575	2.00	0.9525	0.9314	0.9884	1.8525	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9775	2.00	0.9725	0.9471	0.9850	1.8800	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9775	2.00	0.9725	0.9471	0.9584	1.8925	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8000	2.00	0.7950	0.7783	0.8025	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	0.50	0.25	0.15	-1.74	-3.56	0.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.50	0.25	0.15	-0.44	-2.35	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	3.00	-0.25	3.80	2.49	0.73	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.75	-0.50	3.30	3.03	2.30	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	5.75	0.50	5.75	5.65	5.18	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.50	1.00	7.20	7.58	6.90	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.00	1.00	2.45	2.63	2.87	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	4.75	1.50	3.90	4.55	4.59	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.75	0.50	1.45	1.93	1.72	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.75	0.25	2.60	2.08	1.07	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	7.75	0.25	7.60	6.71	5.62	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	0.00	5.00	4.64	4.55	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.58	-0.33	2.75	-9.50	5.25	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	2.00	1.58	-3.00	4.00	-18.00	7.75	-18.00
10*20Y	-15.75	0.00	-15.75	-15.31	-18.59	3.25	-35.00	11.00	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.680	-2.00	0.701	0.660	0.774	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.760	-1.80	0.783	0.750	0.855	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.800	1.50	0.802	0.788	0.900	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.847	1.80	0.855	0.849	0.942	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	1.025	2.80	1.024	1.015	1.114	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.132	3.20	1.134	1.123	1.194	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.263	2.20	1.270	1.250	1.317	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.390	1.50	1.398	1.386	1.452	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.552	3.50	1.547	1.518	1.567	2.106	0.705	2.792	0.705

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.96	-0.06	112.01	112.11	111.96
LKTB	133.44	-0.13	133.47	133.73	133.43

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	9.50	3.00	6.59	10.36	8.18	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	3.25	2.55	0.56	2.71	0.46	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	0.50	-0.75	0.21	0.09	-3.70	2.00	-12.95	2.00	-25.15
3Y	-1.45	-1.55	-1.75	-3.02	-5.55	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-16.25	-1.55	-16.18	-17.01	-19.89	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-25.20	-1.45	-25.73	-25.90	-26.21	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-35.55	-0.20	-36.73	-36.47	-37.46	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-43.25	0.50	-44.57	-45.49	-46.39	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-75.20	-1.50	-75.16	-73.93	-76.46	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1209.60 (+1.60)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-97.50	-3.00	1Y	-0.2000	-2.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-11.00	-0.50		
-104.25	-3.25	1.5Y	-0.2500	-2.50	1.3150	1.1650	2*3Y	5.00	-1.00		
-111.50	-3.25	2Y	-0.3100	-2.50	1.2450	1.0600	2*5Y	17.00	-1.00		
-109.25	-3.75	3Y	-0.2600	-3.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	5.50	0.00		
-106.75	-4.75	4Y	-0.2050	-3.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	12.00	0.00		
-102.00	-5.25	5Y	-0.1400	-3.50	1.1950	-0.4100	4*5Y	6.50	0.00		
-92.75	-5.50	7Y	-0.0200	-3.50	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-84.25	-5.50	10Y	0.1150	-3.50	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	0.1977	0.0003	0.1974	0.1973	0.2172	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6995	-0.0098	0.7093	0.7339	0.7570	2.7589	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	-60.23	-1.47	-58.76	-62.77	-58.28	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-69.05	-2.48	-66.57	-66.31	-65.00	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	15.25	1.25	14.00	15.75	14.50	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	59.00	0.00	59.00	57.20	60.70	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	50.18	-1.01	51.19	53.66	53.98	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS				ODD Tenor					
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	78.5			SPRD	4*6y 3				
03Y									
04Y									
05Y	88								
07Y									
10Y	95								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	100 건	44	56	100	107	57	77	66	
금 액	36,955 억원	18,027	18,928	44,459	28,225	15,939	20,140	17,776	

장중동향

국고채 금리, 국고 10년물 비경쟁인수 물량과 다음 주 20년물 입찰 부담, 7월 국고채발행계획 경계감 등 수급이슈가 집중되며 국고 채 금리 상승, 단기물은 정책당국의 규제 완화 이후에 투자 심리가 호전되면서 수익률곡선은 가팔라짐.

IRS. IRS금리는 국고채 현물을 따라 움직였고, 장기 구간을 중심으로 약세를 보임. 단기 구간은 기재부의 7월 바이백 시행 소식과 금융위원회의 환매조건부채권(RP) 규제 완화 등이 호재로 작용하며 약세가 제한됐고, 장기 구간의 금리 상승세가 더 가팔랐으며 전 구간 상승.

CRS. 전 구간 하락. 마감