

IPS Daily Morning Brief

2020-06-23

종가 기준일 2020-06-22

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7675	0.25	0.7640	0.7784	0.9101	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7725	0.25	0.7665	0.7643	0.8750	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7775	0.25	0.7690	0.7618	0.8520	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7950	0.25	0.7905	0.7768	0.8556	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.8050	0.00	0.8050	0.7895	0.8593	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8350	0.25	0.8375	0.8211	0.8825	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8650	0.25	0.8630	0.8480	0.9109	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8850	0.50	0.8785	0.8679	0.9281	1.7925	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.9125	0.50	0.9050	0.8896	0.9392	1.8000	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9650	0.75	0.9560	0.9361	0.9850	1.8525	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9850	0.75	0.9760	0.9524	0.9829	1.8800	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9850	0.75	0.9760	0.9524	0.9577	1.8925	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7950	-0.50	0.7960	0.7820	0.8013	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	0.50	0.00	0.25	-1.41	-3.51	0.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.50	0.00	0.25	-0.25	-2.30	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	2.75	-0.25	3.60	2.78	0.73	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	3.00	0.25	3.25	3.16	2.33	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	6.00	0.25	5.80	5.85	5.16	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	8.00	0.50	7.35	7.84	6.89	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.00	0.00	2.55	2.69	2.83	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	5.00	0.25	4.10	4.68	4.56	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.00	0.25	1.55	1.99	1.73	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.75	0.00	2.65	2.18	1.11	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	8.00	0.25	7.75	6.83	5.69	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.25	0.25	5.10	4.65	4.58	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.63	-0.21	2.75	-9.50	5.25	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	2.00	1.63	-2.73	4.00	-18.00	7.75	-18.00
10*20Y	-17.00	-1.25	-16.00	-15.41	-18.38	3.25	-35.00	11.00	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.670	-1.00	0.694	0.660	0.769	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.751	-0.90	0.778	0.749	0.850	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.792	-0.80	0.800	0.787	0.895	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.847	0.00	0.851	0.851	0.937	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	1.021	-0.40	1.020	1.018	1.107	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.127	-0.50	1.128	1.127	1.189	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.261	-0.20	1.263	1.254	1.312	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.390	0.00	1.392	1.390	1.447	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.570	1.80	1.547	1.523	1.563	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.79	0.00
CALL	0.47	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.99	0.03	112.00	112.02	111.96
LKTb	133.44	0.00	133.52	133.58	133.21

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	10.75	1.25	7.46	10.23	8.29	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	4.40	1.15	1.27	2.76	0.51	5.35	-10.20	5.35	-19.10
2Y	1.30	0.80	0.46	0.23	-3.54	2.00	-12.95	2.00	-25.15
3Y	-1.20	0.25	-1.35	-2.96	-5.44	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-15.60	0.65	-15.70	-16.98	-19.63	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-24.20	1.00	-24.93	-25.92	-26.07	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-34.85	0.70	-35.82	-36.45	-37.28	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-42.50	0.75	-43.58	-45.40	-46.17	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-77.50	-2.30	-75.12	-74.12	-76.21	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1215.80 (+6.20)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-100.25	-2.75	1Y	-0.2250	-2.50	1.3900	-1.4500	1*2Y	-11.00	0.00		
-107.00	-2.75	1.5Y	-0.2750	-2.50	1.3150	1.1650	2*3Y	4.00	-1.00		
-114.00	-2.50	2Y	-0.3350	-2.50	1.2450	1.0600	2*5Y	15.50	-1.50		
-113.00	-3.75	3Y	-0.2950	-3.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	5.50	0.00		
-110.50	-3.75	4Y	-0.2400	-3.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	11.50	-0.50		
-106.50	-4.50	5Y	-0.1800	-4.00	1.1950	-0.4100	4*5Y	6.00	-0.50		
-97.25	-4.50	7Y	-0.0600	-4.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-89.00	-4.75	10Y	0.0750	-4.00	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	0.1897	-0.0080	0.1977	0.1974	0.1973	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.7061	0.0066	0.6995	0.7093	0.7339	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	0	-60.23	-58.76	-62.77	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-68.39	0.66	-69.05	-66.57	-66.31	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	16.00	0.75	15.25	14.00	15.75	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	59.80	0.80	59.00	59.00	57.20	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	51.64	1.46	50.18	51.19	53.66	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS				ODD Tenor					
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	79.25								
02Y				SPRD					
03Y									
04Y									
05Y	88.5								
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	56 건	-44	100	56	100	107	57	77	
금 액	14,404 억원	-22,551	36,955	18,928	44,459	28,225	15,939	20,140	

장중동향
국고채 금리, 서울 채권시장은 특별한 이슈가 부재한 가운데 한산한 모습을 보이며 이날 진행된 국고채 20년물 입찰에 따른 수급 부담이 더해지면서 장기물 중심으로 금리 상승.

IRS, 보험권에서 혼조세를 보이며 2-3년은 소폭 내린 반면 대부분 구간은 소폭 상승. 좁은 레인지에서 등락하는 장세, 외국 금융기관 20년 이상 구간 오피가 많이 나와 눈길을 끌었으며 롱 포지션 확대인지 구조화 물량인지 거래 의도를 추정하기는 어려움.

CRS, 전 구간 하락. 마감