

IPS Daily Morning Brief

2020-06-24

종가 기준일 2020-06-23

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7625	-0.50	0.7640	0.7708	0.9048	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7675	-0.50	0.7680	0.7596	0.8702	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7725	-0.50	0.7720	0.7589	0.8476	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7850	-1.00	0.7905	0.7753	0.8516	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.7900	-1.50	0.8025	0.7885	0.8555	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8175	-1.75	0.8335	0.8215	0.8794	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8475	-1.75	0.8605	0.8490	0.9077	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8675	-1.75	0.8775	0.8693	0.9251	1.7925	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.8950	-1.75	0.9045	0.8919	0.9366	1.8000	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9475	-1.75	0.9560	0.9386	0.9827	1.8525	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9675	-1.75	0.9760	0.9554	0.9818	1.8800	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9675	-1.75	0.9760	0.9554	0.9580	1.8925	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7775	-1.75	0.7935	0.7835	0.8008	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	0.50	0.00	0.40	-1.11	-3.46	0.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.50	0.00	0.40	-0.08	-2.26	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	1.75	-1.00	3.05	2.96	0.79	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.75	-0.25	3.10	3.30	2.39	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	5.75	-0.25	5.80	6.05	5.22	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.75	-0.25	7.50	8.08	6.96	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.00	0.00	2.70	2.75	2.83	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	5.00	0.00	4.40	4.78	4.57	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.00	0.00	1.70	2.03	1.74	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.75	0.00	2.70	2.26	1.15	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	8.00	0.00	7.85	6.94	5.76	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.25	0.00	5.15	4.68	4.61	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.68	-0.09	2.75	-9.50	5.25	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	2.00	1.68	-2.47	4.00	-18.00	7.75	-18.00
10*20Y	-17.00	0.00	-16.25	-15.51	-18.19	3.25	-35.00	11.00	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.650	-2.00	0.684	0.658	0.763	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.730	-2.10	0.765	0.747	0.846	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.772	-2.00	0.795	0.785	0.889	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.822	-2.50	0.844	0.850	0.932	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	0.997	-2.40	1.015	1.018	1.101	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.105	-2.20	1.122	1.128	1.184	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.241	-2.00	1.256	1.256	1.308	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.375	-1.50	1.385	1.392	1.443	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.560	-1.00	1.548	1.528	1.560	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	112.07	0.08	112.00	112.12	112.00
LKTB	133.60	0.16	133.41	133.93	133.40

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	12.25	1.50	8.78	10.04	8.43	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	5.50	1.10	2.53	2.78	0.59	5.50	-10.20	5.50	-19.10
2Y	1.80	0.50	0.77	0.37	-3.37	2.00	-12.95	2.00	-25.15
3Y	-0.45	0.75	-1.05	-2.82	-5.29	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-14.95	0.65	-15.49	-16.86	-19.34	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-23.75	0.45	-24.43	-25.90	-25.91	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-34.60	0.25	-35.17	-36.43	-37.11	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-42.75	-0.25	-42.94	-45.34	-45.99	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-78.25	-0.75	-75.47	-74.47	-75.96	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1208.80 (-7.00)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-96.75	3.50	1Y	-0.1950	3.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-13.00	-2.00		
-104.00	3.00	1.5Y	-0.2550	2.00	1.3150	1.1600	2*3Y	3.50	-0.50		
-111.50	2.50	2Y	-0.3250	1.00	1.2450	1.0600	2*5Y	14.50	-1.00		
-110.75	2.25	3Y	-0.2900	0.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	5.00	-0.50		
-108.75	1.75	4Y	-0.2400	0.00	1.2000	-0.4750	3*5Y	11.00	-0.50		
-104.75	1.75	5Y	-0.1800	0.00	1.1900	-0.4100	4*5Y	6.00	0.00		
-95.50	1.75	7Y	-0.0600	0.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-87.25	1.75	10Y	0.0750	0.00	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	0.1898	0.0001	0.1897	0.1977	0.1974	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.7193	0.0132	0.7061	0.6995	0.7093	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	-58.22	2.01	-60.23	-60.23	-58.76	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-65.57	2.82	-68.39	-69.05	-66.57	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	-0.25	16.00	15.25	14.00	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	60.30	0.50	59.80	59.00	59.00	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	52.95	1.31	51.64	50.18	51.19	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor	9y 93.5						
06M									
09M									
01Y									
1.5Y	78.75 / 78.5								
02Y	78.75	SPRD	1.5*2y 0.25						
03Y	82								
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y CCS -34								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	74 건	18	56	100	56	100	107	57	
금 액	21,514 억원	7,110	14,404	36,955	18,928	44,459	28,225	15,939	

장중동향
국고채 금리, 단기구간을 중심으로 하락. 외국인인 3년 국채선물을 대량 순매수하는 등 단기물에 대한 심리가 호전된 영향으로 풀이되며 장기구간은 오는 25일 국고채 발행 계획 등을 앞두고 물량 부담을 의식해 보험권에 머무름.

IRS, 전 구간 하락현물 강세를 못 따라가는 느낌으로 재료 대비해 덜 강했으며 전반적으로 스와프 시장이 근래 조용한 가운데 오늘도 변동성은 제한적. 역외에서도 별다른 움직임이 없었음.

CRS, 3년 이하 구간 상승. 마감