

IPS Daily Morning Brief

2020-06-25

종가 기준일 2020-06-24

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7625	0.00	0.7635	0.7631	0.9000	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7675	0.00	0.7680	0.7550	0.8660	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7725	0.00	0.7725	0.7560	0.8439	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7850	0.00	0.7885	0.7736	0.8483	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.7925	0.25	0.7980	0.7874	0.8526	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8150	-0.25	0.8260	0.8215	0.8773	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8450	-0.25	0.8540	0.8498	0.9058	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8650	-0.25	0.8720	0.8705	0.9236	1.7925	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.8950	0.00	0.8995	0.8943	0.9358	1.8000	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9450	-0.25	0.9505	0.9411	0.9823	1.8525	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9650	-0.25	0.9705	0.9584	0.9825	1.8800	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9650	-0.25	0.9705	0.9584	0.9598	1.8925	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7750	-0.25	0.7855	0.7850	0.8019	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	0.50	0.00	0.45	-0.81	-3.40	0.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.50	0.00	0.45	0.10	-2.22	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	2.00	0.25	2.55	3.14	0.88	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.25	-0.50	2.80	3.41	2.47	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	5.25	-0.50	5.60	6.24	5.32	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.25	-0.50	7.40	8.31	7.10	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.00	0.00	2.80	2.83	2.85	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	5.00	0.00	4.60	4.90	4.63	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	2.00	0.00	1.80	2.08	1.78	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	3.00	0.25	2.75	2.38	1.22	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	8.00	0.00	7.85	7.06	5.87	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	-0.25	5.10	4.69	4.65	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.73	0.02	2.75	-9.50	5.25	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	2.00	1.73	-2.25	4.00	-18.00	7.75	-18.00
10*20Y	-17.00	0.00	-16.50	-15.61	-18.04	3.25	-35.00	11.00	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.648	-0.20	0.670	0.657	0.758	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.725	-0.50	0.749	0.746	0.841	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.777	0.50	0.785	0.783	0.884	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.820	-0.20	0.833	0.848	0.928	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	0.990	-0.70	1.006	1.017	1.096	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.090	-1.50	1.111	1.129	1.181	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.226	-1.50	1.246	1.258	1.305	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.362	-1.30	1.378	1.394	1.440	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.547	-1.30	1.549	1.533	1.560	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	112.13	0.06	112.08	112.16	112.08
LKTb	133.74	0.14	133.60	133.96	133.53

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	12.45	0.20	10.29	9.87	8.63	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	6.00	0.50	3.97	2.81	0.72	6.00	-10.20	6.00	-19.10
2Y	1.55	-0.25	1.28	0.48	-3.17	2.00	-12.95	2.00	-25.15
3Y	-0.50	-0.05	-0.70	-2.67	-5.08	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-14.50	0.45	-15.20	-16.71	-19.06	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-22.50	1.25	-23.88	-25.81	-25.74	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-33.10	1.50	-34.69	-36.34	-36.91	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-41.70	1.05	-42.79	-45.25	-45.80	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-77.20	1.05	-76.37	-74.82	-75.78	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1199.40 (-9.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-89.75	7.00	1Y	-0.1250	7.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-14.00	-1.00		
-97.50	6.50	1.5Y	-0.1900	6.50	1.3150	1.1600	2*3Y	3.00	-0.50		
-105.75	5.75	2Y	-0.2650	6.00	1.2450	1.0600	2*5Y	15.00	0.50		
-105.00	5.75	3Y	-0.2350	5.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	5.00	0.00		
-103.00	5.75	4Y	-0.1850	5.50	1.2000	-0.4750	3*5Y	12.00	1.00		
-98.00	6.75	5Y	-0.1150	6.50	1.1900	-0.4100	4*5Y	7.00	1.00		
-89.50	6.00	7Y	0.0000	6.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	11.50	-0.50		
-81.00	6.25	10Y	0.1350	6.00	1.4000	-0.1250	5*10Y	25.00	-0.50		

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	0.1794	-0.0104	0.1898	0.1897	0.1977	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6831	-0.0362	0.7193	0.7061	0.6995	2.7540	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	-59.76	-1.54	-58.22	-60.23	-60.23	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-67.89	-2.32	-65.57	-68.39	-69.05	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	-0.50	15.75	16.00	15.25	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	58.50	-1.80	60.30	59.80	59.00	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	50.37	-2.58	52.95	51.64	50.18	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M									
09M									
01Y	81.25								
1.5Y									
02Y	79		SPRD	5*10y 08					
03Y	81 / 81.25			2*3y 02					
04Y				10*12y 02					
05Y				4*5y 2 / 1.75					
07Y				1.5*2y 05					
10Y				2*10y 15					
12Y				3*10y 13					
15Y	90.5								
20Y									
CRS	3y CCR -27.5 / -27								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	92 건	18	74	56	100	56	100	107	
금 액	30,156 억원	8,642	21,514	14,404	36,955	18,928	44,459	28,225	

장중동향
국고채 금리, 전 구간 하락. 서울 채권시장은 반기 말 영향권에 들어온 가운데 장중에 특별한 재료 없이 외국인 선물 매수세에 연동해 강세 마감.

IRS, 보험권에서 대체로 강세를 나타냈으며 국채선물 강세를 따라가지 못하고 보험권에 그침. 특이한 점은 15년 구간에서 외국계 은행의 비드가 많았음.

CRS, 전 구간 상승. 마감