

IPS Daily Morning Brief

2020-06-29

종가 기준일 2020-06-26

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7600	0.50	0.7615	0.7615	0.8912	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7600	0.00	0.7655	0.7560	0.8583	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7600	-0.25	0.7690	0.7574	0.8369	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7725	-0.25	0.7825	0.7759	0.8418	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.7800	-0.25	0.7900	0.7896	0.8467	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8000	-0.50	0.8145	0.8231	0.8717	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8225	-0.75	0.8420	0.8518	0.9001	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8325	-1.25	0.8590	0.8714	0.9183	1.7925	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.8525	-1.75	0.8850	0.8965	0.9314	1.8000	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9050	-1.50	0.9365	0.9440	0.9783	1.8525	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9250	-1.50	0.9565	0.9621	0.9806	1.8800	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9250	-1.50	0.9565	0.9621	0.9599	1.8925	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7375	-1.25	0.7670	0.7860	0.8008	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	0.00	-0.50	0.40	-0.55	-3.29	0.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.00	-0.25	0.35	0.14	-2.14	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	2.00	0.00	2.10	3.23	0.98	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.00	-0.25	2.45	3.35	2.50	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	4.25	-0.50	5.20	6.21	5.34	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	5.25	-1.00	6.90	8.18	7.16	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.25	-0.25	2.75	2.86	2.85	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	3.25	-0.75	4.45	4.83	4.66	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.00	-0.50	1.70	1.96	1.82	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.00	-0.50	2.60	2.51	1.31	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	7.25	-0.25	7.75	7.26	6.00	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.25	0.25	5.15	4.75	4.69	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.81	0.23	2.75	-9.50	5.25	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	2.00	1.81	-1.84	4.00	-18.00	7.75	-18.00
10*20Y	-16.75	0.25	-16.95	-15.80	-17.75	3.25	-35.00	11.00	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.659	0.40	0.656	0.663	0.746	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.724	-0.10	0.731	0.747	0.831	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.777	0.00	0.779	0.784	0.874	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.812	-0.30	0.823	0.848	0.919	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	0.962	-1.00	0.988	1.014	1.086	1.905	0.962	2.502	0.962
5Y	1.070	-1.00	1.094	1.127	1.174	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.197	-1.00	1.226	1.257	1.297	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.325	-1.20	1.358	1.391	1.433	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.517	-1.80	1.546	1.538	1.556	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.79	0.00
CALL	0.50	3.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	112.14	-0.01	112.17	112.18	112.12
LKTb	134.14	0.12	134.10	134.32	133.93

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	10.10	-0.65	11.26	9.49	9.14	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	4.85	-0.15	5.15	2.88	1.11	6.00	-10.20	6.00	-19.10
2Y	0.30	-0.25	1.10	0.54	-2.77	2.00	-12.95	2.00	-25.15
3Y	-1.20	-0.20	-0.87	-2.51	-4.73	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-13.95	0.25	-14.64	-16.27	-18.54	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-23.75	-0.25	-23.54	-25.59	-25.53	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-34.45	-0.75	-34.14	-36.02	-36.60	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-42.00	-0.30	-42.13	-44.70	-45.46	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-77.95	0.55	-77.88	-75.22	-75.48	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1200.60 (-4.10)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-82.50	7.25	1Y	-0.0650	7.00	1.3850	-1.4500	1*2Y	-14.50	-0.50		
-90.75	6.75	1.5Y	-0.1350	6.50	1.3100	1.1600	2*3Y	3.00	0.00		
-99.00	6.75	2Y	-0.2100	6.50	1.2450	1.0600	2*5Y	16.00	1.00		
-98.00	7.00	3Y	-0.1800	6.50	1.2150	-0.5650	3*4Y	5.00	0.00		
-95.25	7.25	4Y	-0.1300	6.50	1.1950	-0.4750	3*5Y	13.00	1.00		
-88.25	8.75	5Y	-0.0500	7.50	1.1850	-0.4100	4*5Y	8.00	1.00		
-78.25	9.75	7Y	0.0700	8.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	12.00	0.50		
-72.00	9.50	10Y	0.1850	8.00	1.4000	-0.1250	5*10Y	23.50	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	0.1680	-0.0154	0.1834	0.1794	0.1898	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6471	-0.0377	0.6848	0.6831	0.7193	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	-60.90	-1.54	-59.36	-59.76	-58.22	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-67.79	-2.57	-65.22	-67.89	-65.57	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	12.50	-1.25	13.75	15.25	15.75	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	54.80	-1.20	56.00	58.50	60.30	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	47.91	-2.23	50.14	50.37	52.95	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL										
IRS					ODD Tenor					
	06M									
	09M	88								
	01Y	74.75 / 76								
	1.5Y				SPRD					
	02Y	78.25 / 77				4*5y 01				
	03Y					8*10y 04				
	04Y					6*7y 01				
	05Y	83.5 / 83				3*10y 10.5				
	07Y					2*10y 13				
10Y										
12Y										
15Y										
20Y										
CRS										
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6		
거래현황	86 건	9	77	92	74	56	100	56		
금 액	20,266 억원	-367	20,633	30,156	21,514	14,404	36,955	18,928		

장중동향
 국고채 금리. 서울 채권시장은 반기 말을 맞아 한산한 분위기가 이어진 가운데 장기 구간에서는 7월 국고채 발행계획 규모가 시장 예상보다 적어 수급 부담을 덜며 국고채 금리가 외국인 국채선물 순매수에 힘입어 하락.

IRS. 장기 구간 위주로 하락하며 수익률 곡선이 평탄해짐(커브 플랫닝). 최근 5년 구간을 중심으로 오퍼 물량이 많았는데, 외국계 오퍼로 추정되며 장기 구간은 여전히 이를 소화시키고 있는 모습.

CRS. 전 구간 상승. 마감