

IPS Daily Morning Brief

2020-07-01

종가 기준일 2020-06-30

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7650	0.50	0.7605	0.7636	0.8823	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7675	0.75	0.7630	0.7604	0.8505	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7700	0.75	0.7655	0.7628	0.8302	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7850	1.00	0.7785	0.7816	0.8350	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.8000	1.50	0.7880	0.7955	0.8400	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8300	2.25	0.8115	0.8286	0.8649	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8525	2.50	0.8355	0.8571	0.8931	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8650	2.75	0.8490	0.8758	0.9113	1.7925	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.8925	2.75	0.8750	0.9021	0.9253	1.7975	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9425	2.50	0.9260	0.9509	0.9726	1.8375	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9625	2.50	0.9460	0.9699	0.9772	1.8650	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9625	2.50	0.9460	0.9699	0.9584	1.8750	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7750	2.50	0.7575	0.7914	0.7978	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	0.25	0.25	0.25	-0.33	-3.18	0.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.25	0.00	0.25	0.24	-2.04	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	3.00	0.75	2.25	3.28	0.99	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	3.00	0.75	2.35	3.31	2.49	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	5.25	1.00	4.75	6.16	5.30	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	6.50	1.25	6.10	8.03	7.12	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.25	0.25	2.40	2.85	2.82	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	3.50	0.50	3.75	4.71	4.63	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.25	0.25	1.35	1.86	1.82	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.75	0.00	2.60	2.64	1.40	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	7.75	-0.25	7.70	7.51	6.14	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	-0.25	5.10	4.88	4.73	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.90	0.45	2.75	-9.50	5.25	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	2.00	1.90	-1.43	4.00	-18.00	7.75	-18.00
10*20Y	-16.75	0.00	-16.85	-15.95	-17.48	3.25	-35.00	11.00	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.651	-1.90	0.657	0.669	0.734	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.731	-0.40	0.728	0.751	0.820	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.795	0.50	0.783	0.787	0.865	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.845	0.80	0.826	0.849	0.911	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	0.997	1.20	0.981	1.013	1.076	1.895	0.962	2.502	0.962
5Y	1.115	2.30	1.089	1.126	1.167	1.909	1.050	2.602	1.050
7Y	1.250	2.40	1.221	1.257	1.291	2.006	1.163	2.728	1.163
10Y	1.385	2.80	1.353	1.390	1.427	2.027	1.170	2.815	1.170
20Y	1.585	3.30	1.547	1.543	1.552	2.106	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	0.79	0.00
CALL	0.59	10.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	112.04	-0.05	112.08	112.10	112.01
LKTb	133.55	-0.26	133.74	133.86	133.55

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투입 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	11.90	2.65	10.89	9.36	9.60	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	5.40	1.40	5.05	3.06	1.47	6.00	-10.20	6.00	-19.10
2Y	0.50	1.00	0.48	0.80	-2.54	2.00	-12.95	2.00	-25.15
3Y	-1.50	1.45	-1.43	-2.05	-4.61	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-14.45	1.30	-14.57	-15.59	-18.25	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-25.00	0.45	-24.04	-25.07	-25.53	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-35.75	0.35	-34.62	-35.49	-36.56	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-44.25	-0.30	-42.72	-43.92	-45.42	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-81.00	-0.80	-78.97	-75.18	-75.46	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1203.00 (+4.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-89.50	-3.75	1Y	-0.1250	-3.00	1.3800	-1.4500	1*2Y	-13.00	0.50		
-97.00	-3.50	1.5Y	-0.1850	-2.50	1.2900	1.0900	2*3Y	3.00	-0.50		
-105.50	-4.00	2Y	-0.2550	-2.50	1.2250	1.0250	2*5Y	17.50	0.00		
-105.50	-5.25	3Y	-0.2250	-3.00	1.2000	-0.5650	3*4Y	6.00	0.50		
-101.75	-5.00	4Y	-0.1650	-2.50	1.1850	-0.4750	3*5Y	14.50	0.50		
-94.50	-5.25	5Y	-0.0800	-2.50	1.1750	-0.4100	4*5Y	8.50	0.00		
-85.25	-5.25	7Y	0.0400	-2.50	1.2550	-0.3100	5*7Y	12.00	0.00		
-78.75	-5.00	10Y	0.1550	-2.50	1.3900	-0.1250	5*10Y	23.50	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	0.1485	-0.0117	0.1602	0.1680	0.1834	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6545	0.0295	0.6250	0.6471	0.6848	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	-64.65	-1.67	-62.98	-60.90	-59.36	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-73.05	0.15	-73.20	-67.79	-65.22	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	14.25	1.00	13.25	12.50	13.75	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	59.00	2.30	56.70	54.80	56.00	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	50.60	4.12	46.48	47.91	50.14	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y									
1.5Y									
02Y	78.5 / 79.5	SPRD			1*1.5	1.25			
03Y	83				4*5	1.25			
04Y					2*6	7.75			
05Y	84.25				10*12	02			
07Y					5*10	8/ 7.5			
10Y					7*8	1			
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	4*5 8.5								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	77 건	12	65	86	77	92	74	56	
금 액	25,705 억원	2,307	23,398	20,266	20,633	30,156	21,514	14,404	

장중동향
국고채 금리 중장기 구간 중심으로 상승. 단기 구간은 강보합세 나타내 수익률 곡선 가팔라짐. (커브 스티프닝)

IRS. 전구간 상승. 대부분 구간 비드 우위, 단기를 오픈 나오긴 했으나 전반적으로 비디쉬했음

CRS. 전구간에서 하락