IPS Daily Morning Brief

2020-06-26

종가 기준일 2020-06-25

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.7550	-0.75	0.7625	0.7611	0.8957	1.8975	0.7400	1.9125	0.7400
9M	0.7600	-0.75	0.7675	0.7545	0.8623	1.8925	0.7175	1.9125	0.7175
1Y	0.7625	-1.00	0.7720	0.7556	0.8405	1.8800	0.7100	1.9200	0.7100
1.5Y	0.7750	-1.00	0.7865	0.7738	0.8452	1.8650	0.7200	2.0250	0.7200
2Y	0.7825	-1.00	0.7950	0.7875	0.8500	1.8425	0.7300	2.1150	0.7300
3Y	0.8050	-1.00	0.8210	0.8216	0.8748	1.8125	0.7600	2.2225	0.7600
4Y	0.8300	-1.50	0.8500	0.8501	0.9033	1.8000	0.7825	2.2950	0.7825
5Y	0.8450	-2.00	0.8685	0.8705	0.9214	1.7925	0.8000	2.3400	0.8000
7Y	0.8700	-2.50	0.8960	0.8949	0.9340	1.8000	0.8150	2.3950	0.8150
10Y	0.9200	-2.50	0.9470	0.9418	0.9807	1.8525	0.8525	2.4850	0.8525
12Y	0.9400	-2.50	0.9670	0.9595	0.9820	1.8800	0.8625	2.5225	0.8625
15Y	0.9400	-2.50	0.9670	0.9595	0.9603	1.8925	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.7500	-2.50	0.7795	0.7846	0.8017	1.8700	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	0.50	0.00	0.50	-0.66	-3.34	0.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	0.25	-0.25	0.45	0.11	-2.18	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	2.00	0.00	2.30	3.19	0.95	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.25	0.00	2.60	3.41	2.48	5.75	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	4.75	-0.50	5.50	6.26	5.33	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	6.25	-1.00	7.35	8.30	7.15	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	2.50	-0.50	2.90	2.85	2.85	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	4.00	-1.00	4.75	4.89	4.66	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.50	-0.50	1.85	2.04	1.81	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	2.50	-0.50	2.75	2.44	1.26	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	7.50	-0.50	7.85	7.13	5.93	8.25	0.50	22.25	0.50
7*10Y	5.00	0.00	5.10	4.69	4.67	5.75	1.50	12.75	1.50
10*12Y	2.00	0.00	2.00	1.78	0.12	2.75	-9.50	5.25	-9.50
10*15Y	2.00	0.00	2.00	1.78	-2.05	4.00	-18.00	7.75	-18.00
10*20Y	-17.00	0.00	-16.75	-15.71	-17.90	3.25	-35.00	11.00	-35.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.655	0.70	0.661	0.659	0.752	1.918	0.588	1.935	0.588
1.5Y	0.725	0.00	0.738	0.746	0.836	1.932	0.691	2.113	0.691
2Y	0.777	0.00	0.784	0.783	0.880	1.944	0.747	2.230	0.747
3Y	0.815	-0.50	0.830	0.848	0.924	1.835	0.022	2.315	0.022
4Y	0.972	-1.80	1.001	1.016	1.091	1.905	0.967	2.502	0.967
5Y	1.080	-1.00	1.107	1.128	1.178	1.910	1.050	2.602	1.050
7Y	1.207	-1.90	1.240	1.258	1.302	2.028	1.163	2.728	1.163
10Y	1.337	-2.50	1.371	1.393	1.437	2.047	1.170	2.815	1.170
20Y	1.535	-1.20	1.553	1.537	1.558	2.106	0.705	2.792	0.705

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	112.15	0.02	112.16	112.17	112.12
LKTB	134.02	0.28	133.95	134.02	133.73

BOND SWAP SPRD

(1-2Y 통안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	10.75	-1.70	11.14	9.64	8.88	16.00	-5.30	16.00	-17.75
1.5Y	5.00	-1.00	4.83	2.83	0.92	6.00	-10.20	6.00	-19.10
2Y	0.55	-1.00	1.14	0.48	-2.97	2.00	-12.95	2.00	-25.15
3Y	-1.00	-0.50	-0.92	-2.65	-4.91	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-14.20	0.30	-15.10	-16.56	-18.81	-6.25	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-23.50	-1.00	-23.83	-25.78	-25.65	-7.95	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-33.70	-0.60	-34.36	-36.28	-36.75	-15.90	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-41.70	0.00	-42.38	-45.12	-45.62	-13.95	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-78.50	-1.30	-77.33	-75.21	-75.64	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-89.75	0.00
-97.50	0.00
-105.75	0.00
-105.00	0.00
-102.50	0.50
-97.00	1.00
-88.00	1.50
-81.50	-0.50

CRS

USD/KRW 1204.70 (+5.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	-0.1350	-1.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-14.00	0.00
1.5Y	-0.2000	-1.00	1.3150	1.1600	2*3Y	3.00	0.00
2Y	-0.2750	-1.00	1.2450	1.0600	2*5Y	15.00	0.00
3Y	-0.2450	-1.00	1.2150	-0.5650	3*4Y	5.00	0.00
4Y	-0.1950	-1.00	1.2000	-0.4750	3*5Y	12.00	0.00
5Y	-0.1250	-1.00	1.1900	-0.4100	4*5Y	7.00	0.00
7Y	-0.0100	-1.00	1.2650	-0.3100	5*7Y	11.50	0.00
10Y	0.1050	-3.00	1.4000	-0.1250	5*10Y	23.00	-2.00

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	0.1834	0.0040	0.1794	0.1898	0.1897	2.7020	0.1290	2.9773	0.1290
10Y	0.6848	0.0017	0.6831	0.7193	0.7061	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	-59.36	0.4	-59.76	-58.22	-60.23	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-65.22	2.67	-67.89	-65.57	-68.39	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	13.75	-1.50	15.25	15.75	16.00	21.00	-9.50	42.50	-9.50
KTB 2*10Y	56.00	-2.50	58.50	60.30	59.80	66.60	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	50.14	-0.23	50.37	52.95	51.64	68.97	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M	76		
01Y	76.5		
1.5Y			
02Y	78.25	SPRD	5*12y 9.25
03Y	81.75 / 81.5		10*12y 2
04Y			
05Y	86.5 / 85.25		
07Y			
10Y			
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	2*5y CCR 15		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	77 건	-15	92	74	56	100	56	100
금 액	20,633 억원	-9,523	30,156	21,514	14,404	36,955	18,928	44,459

장중동향

국고채 금리. 장중 이주열 한은 총재가 매파적 발언을 내놓으면서 시장이 일시 약세로 돌아섰지만 외국인이 저가 매수를 지속하면서 금리는 하락마감.

IRS. 전 구간 하락. 아침에는 비드가 강했는데 오후로 넘어가면서 외국인 선물 매수와 주식 조정에 따라 강세가 연출됨. 이주열 총재 발언은 모호하게 전달되면서 롱이 더 나옴.

CRS. 전 구간 하락. 마감