

IPS Daily Morning Brief

2019-05-21

종가 기준일 2019-05-20

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8200	0.50	1.8190	1.8276	1.8601	1.9125	1.6750	2.0875	1.2875
9M	1.7850	0.50	1.7880	1.8056	1.8433	1.9125	1.7375	2.0525	1.2500
1Y	1.7550	0.50	1.7620	1.7825	1.8228	1.9200	1.7500	2.0325	1.2200
1.5Y	1.7200	1.00	1.7240	1.7458	1.7873	2.0250	1.7100	2.0325	1.1900
2Y	1.6775	1.00	1.6830	1.7053	1.7509	2.1150	1.6675	2.1150	1.1675
3Y	1.6475	1.25	1.6530	1.6758	1.7181	2.2225	1.6350	2.2225	1.1550
4Y	1.6325	1.25	1.6405	1.6650	1.7032	2.2950	1.6150	2.2950	1.1575
5Y	1.6275	1.50	1.6350	1.6585	1.6959	2.3400	1.6050	2.3400	1.1575
7Y	1.6200	1.50	1.6290	1.6554	1.6921	2.3950	1.5950	2.3950	1.1675
10Y	1.6500	1.25	1.6590	1.6848	1.7202	2.4850	1.6150	2.4850	1.2125
12Y	1.6775	1.25	1.6865	1.7106	1.7461	2.5225	1.6425	2.5225	1.2150
15Y	1.6850	1.25	1.6940	1.7191	1.7524	2.5400	1.6450	2.5400	1.2150
20Y	1.6625	1.25	1.6735	1.6994	1.7336	2.5600	1.6225	2.6500	1.2150

6*9M	-3.50	0.00	-3.10	-2.20	-1.68	8.50	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-3.00	0.00	-2.60	-2.31	-2.05	8.25	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-7.75	0.50	-7.90	-7.73	-7.19	23.00	-11.00	23.00	-11.00
2*3Y	-3.00	0.25	-3.00	-2.95	-3.28	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-4.50	0.25	-4.25	-4.03	-4.77	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-5.00	0.50	-4.80	-4.68	-5.00	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-1.50	0.00	-1.25	-1.08	-1.49	8.50	-2.50	11.25	-2.50
3*5Y	-2.00	0.25	-1.80	-1.73	-2.22	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-0.50	0.25	-0.55	-0.65	-0.73	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	-0.75	0.00	-0.60	-0.31	-0.38	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	2.25	-0.25	2.40	2.63	2.43	16.25	0.75	30.75	0.75
7*10Y	3.00	-0.25	3.00	2.94	2.81	9.50	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.59	2.59	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.50	0.00	3.50	3.44	3.22	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	1.25	0.00	1.45	1.46	1.34	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.682	0.00	1.691	1.727	1.776	1.935	1.682	2.020	1.237
1.5Y	1.683	0.30	1.693	1.732	1.781	2.113	1.680	2.113	1.232
2Y	1.707	0.70	1.711	1.737	1.777	2.230	1.697	2.230	1.225
3Y	1.677	1.00	1.685	1.714	1.751	2.315	1.667	2.315	1.200
4Y	1.737	1.20	1.745	1.769	1.808	2.502	1.725	2.502	1.232
5Y	1.725	2.00	1.729	1.754	1.795	2.602	1.697	2.602	1.217
7Y	1.810	2.10	1.810	1.836	1.880	2.728	1.779	2.728	1.270
10Y	1.847	2.20	1.844	1.872	1.912	2.815	1.805	2.815	1.355
20Y	1.877	2.20	1.877	1.903	1.948	2.792	1.840	2.817	1.430

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.84	0.00
CALL	1.75	1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	109.65	-0.04	109.65	109.66	109.62
LKTB	128.69	-0.24	128.77	128.79	128.63

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 반영평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	7.30	0.50	7.14	5.58	4.73	7.85	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	3.70	0.70	3.12	1.39	0.66	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-2.95	0.30	-2.82	-3.14	-2.64	-0.25	-15.70	-0.25	-25.15
3Y	-2.95	0.25	-3.22	-3.79	-3.30	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-10.45	0.05	-10.43	-10.44	-10.44	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-9.75	-0.50	-9.44	-9.54	-9.92	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-19.00	-0.60	-18.14	-18.03	-18.83	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-19.70	-0.95	-18.50	-18.68	-19.18	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-21.45	-0.95	-20.33	-20.31	-21.40	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1194.20 (-1.50)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-71.50	0.00	1Y	1.0400	0.50	1.4750	0.9950	1*2Y	-10.00	0.50		
-74.50	-0.50	1.5Y	0.9750	0.50	1.5250	1.2350	2*3Y	-2.50	0.50		
-73.75	0.00	2Y	0.9400	1.00	1.5650	1.3200	2*5Y	-2.50	0.50		
-73.25	0.25	3Y	0.9150	1.50	1.6550	0.9000	3*4Y	0.00	0.00		
-71.75	0.25	4Y	0.9150	1.50	1.7200	0.8900	3*5Y	0.00	0.00		
-71.25	0.00	5Y	0.9150	1.50	1.7800	0.8750	4*5Y	0.00	0.00		
-64.00	0.00	7Y	0.9800	1.50	1.8950	0.9300	5*7Y	6.50	0.00		
-53.00	0.25	10Y	1.1200	1.50	2.0500	1.0700	5*10Y	20.50	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	2.2290	0.0288	2.2002	2.1881	2.1637	2.9773	1.8870	2.9773	0.4500
10Y	2.4201	0.0274	2.3927	2.3918	2.3768	3.2382	2.3735	3.2382	1.3600

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	52.20	2.18	50.02	49.11	43.87	103.03	-22.88	103.03	-149.00
10Y	57.31	0.54	56.77	57.08	51.68	98.82	-11.26	98.82	-54.00

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-2.75	0.25	-3.00	-3.25	-2.00	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTb 2*10Y	14.00	1.50	12.50	12.40	13.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	19.11	-0.14	19.25	20.37	21.31	79.07	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS		ODD Tenor							
06M									
09M									
01Y	75.5								
1.5Y									
02Y	68.25	SPRD	6*10Y 03						
03Y	65								
04Y									
05Y									
07Y									
10Y									
12Y									
15Y									
20Y									
CRS	2y CCS 93								
TODAY KRX CCP		전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6	
거래현황	52 건	-21	73	119	79	89	66	89	
금 액	15,710 억원	-24,900	40,610	46,295	22,914	26,950	19,621	34,135	

장중동향
국고채 금리, 미중 무역분쟁 글로벌 이슈 대기 속 관망세가 짙었으며 금리는 상승 마감.

IRS, 전 구간 금리 상승.
1Y 구간을 중심으로 비디쉬한 모습.

CRS, 전 구간 금리 상승.