IPS Daily Morning Brief

2019-05-29

종가 기준일 2019-05-28

IRS

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	1.8050	0.25	1.8030	1.8186	1.8521	1.9125	1.6750	2.0875	1.2875
9M	1.7675	1.25	1.7615	1.7921	1.8320	1.9125	1.7375	2.0525	1.2500
1Y	1.7250	1.50	1.7205	1.7639	1.8085	1.9200	1.7075	2.0325	1.2200
1.5Y	1.6575	0.75	1.6640	1.7214	1.7698	2.0250	1.6500	2.0325	1.1900
2Y	1.6125	0.75	1.6195	1.6791	1.7320	2.1150	1.6050	2.1150	1.1675
3Y	1.5750	0.75	1.5835	1.6480	1.6989	2.2225	1.5675	2.2225	1.1550
4Y	1.5550	0.25	1.5685	1.6363	1.6836	2.2950	1.5525	2.2950	1.1575
5Y	1.5450	0.00	1.5625	1.6298	1.6762	2.3400	1.5450	2.3400	1.1575
7Y	1.5375	0.00	1.5555	1.6255	1.6716	2.3950	1.5375	2.3950	1.1675
10Y	1.5650	0.00	1.5830	1.6548	1.6985	2.4850	1.5650	2.4850	1.2125
12Y	1.5925	0.00	1.6105	1.6814	1.7244	2.5225	1.5925	2.5225	1.2150
15Y	1.5950	-0.50	1.6170	1.6896	1.7304	2.5400	1.5950	2.5400	1.2150
20Y	1.5575	-0.75	1.5880	1.6683	1.7094	2.5600	1.5575	2.6500	1.2150
6*9M	-3.75	1.00	-4.15	-2.65	-2.02	8.50	-5.25	12.50	-6.00
9*12M	-4.25	0.25	-4.10	-2.83	-2.35	8.25	-4.50	10.50	-4.50
1*2Y	-11.25	-0.75	-10.10	-8.47	-7.65	23.00	-11.25	23.00	-11.25
2*3Y	-3.75	0.00	-3.60	-3.11	-3.31	13.25	-4.25	13.25	-4.25
2*4Y	-5.75	-0.50	-5.10	-4.29	-4.84	21.75	-6.50	23.50	-6.50
2*5Y	-6.75	-0.75	-5.70	-4.94	-5.58	27.25	-7.75	34.00	-7.75
3*4Y	-2.00	-0.50	-1.50	-1.18	-1.53	8.50	-2.50	11.25	-2.50
3*5Y	-3.00	-0.75	-2.10	-1.83	-2.27	14.00	-3.50	22.00	-3.50
4*5Y	-1.00	-0.25	-0.60	-0.65	-0.75	6.00	-1.25	10.75	-1.25
5*7Y	-0.75	0.00	-0.70	-0.43	-0.46	7.25	-1.25	14.75	-1.25
5*10Y	2.00	0.00	2.05	2.50	2.23	16.25	0.75	30.75	0.75
7*10Y	2.75	0.00	2.75	2.92	2.69	9.50	1.75	16.75	1.75
10*12Y	2.75	0.00	2.75	2.66	2.59	4.50	2.00	7.75	-0.25
10*15Y	3.00	-0.50	3.40	3.49	3.19	6.75	2.00	13.00	-0.75
10*20Y	-0.75	-0.75	0.50	1.35	1.09	10.25	-1.50	27.50	-11.00

BOND

Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	1.673	0.00	1.674	1.702	1.759	1.935	1.672	2.020	1.237
1.5Y	1.672	0.00	1.673	1.706	1.763	2.113	1.671	2.113	1.232
2Y	1.675	-0.20	1.679	1.717	1.761	2.230	1.675	2.230	1.225
3Y	1.647	0.00	1.648	1.690	1.734	2.315	1.642	2.315	1.200
4Y	1.695	-0.70	1.702	1.747	1.790	2.502	1.695	2.502	1.232
5Y	1.675	-0.70	1.685	1.731	1.775	2.602	1.675	2.602	1.217
7Y	1.756	-0.60	1.767	1.814	1.859	2.728	1.756	2.728	1.270
10Y	1.787	-0.80	1.800	1.849	1.893	2.815	1.787	2.815	1.355
20Y	1.825	-1.50	1.843	1.884	1.925	2.792	1.825	2.817	1.430

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

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTB	109.77	0.01	109.78	109.78	109.69
LKTB	129.32	0.07	129.32	129.35	129.05

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	5.20	1.50	4.65	6.15	4.92	7.85	-9.65	9.00	-17.75
1.5Y	-1.45	0.75	-0.86	1.52	0.70	3.70	-12.55	3.70	-19.10
2Y	-6.25	0.95	-5.99	-3.81	-2.89	-0.25	-15.70	-0.25	-25.15
3Y	-7.20	0.75	-6.43	-4.23	-3.55	2.55	-13.50	4.75	-19.50
4Y	-14.00	0.95	-13.31	-11.09	-10.66	-4.50	-25.00	2.00	-30.35
5Y	-13.00	0.70	-12.23	-10.15	-9.92	-3.20	-27.25	4.55	-27.25
7Y	-21.85	0.60	-21.19	-18.83	-18.78	-7.85	-35.15	-4.70	-37.65
10Y	-22.20	0.80	-21.74	-19.38	-19.42	-7.50	-37.50	-7.50	-38.70
20Y	-26.75	0.75	-25.50	-21.60	-21.55	1.75	-29.60	1.75	-48.50

BASIS SWAP

Lv.	전일비
-77.00	-1.00
-76.75	-0.75
-78.25	-0.75
-76.50	-0.75
-73.00	-0.25
-71.50	0.00
-62.75	0.00
-49.50	0.00

CRS

USD/KRW 1185.80 (+1.30)

Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비
1Y	0.9550	0.50	1.4750	0.9500	1*2Y	-12.50	-0.50
1.5Y	0.8900	0.00	1.5250	1.2000	2*3Y	-2.00	0.00
2Y	0.8300	0.00	1.5650	1.2900	2*5Y	0.00	0.00
3Y	0.8100	0.00	1.6550	0.8050	3*4Y	1.50	0.00
4Y	0.8250	0.00	1.7200	0.8150	3*5Y	2.00	0.00
5Y	0.8300	0.00	1.7800	0.8150	4*5Y	0.50	0.00
7Y	0.9100	0.00	1.8950	0.8850	5*7Y	8.00	0.00
10Y	1.0700	0.00	2.0500	1.0450	5*10Y	24.00	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	2.1161	-0.0460	2.1621	2.1621	2.1543	2.9773	1.9602	2.9773	0.4800
10Y	2.2649	-0.0615	2.3264	2.3264	2.3229	3.2382	2.2649	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	44.11	-4.4	48.51	48.71	47.93	103.03	-16.38	103.03	-147.70
10Y	47.79	-5.35	53.14	53.14	52.29	98.82	-11.26	98.82	-47.20

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	-4.75	-0.75	-4.00	-3.50	-3.25	42.50	-6.50	62.75	-6.50
KTB 2*10Y	11.20	-0.60	11.80	12.00	12.50	63.50	4.30	82.90	4.30
UST 2*10Y	14.88	-1.55	16.43	16.43	16.86	79.07	-23.40	177.00	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL

IRS			
06M		ODD Tenor	
09M			
01Y			
1.5Y	66		
02Y	60.25	SPRD	5y*10y 2
03Y	58.25		
04Y			
05Y			
07Y			
10Y	56.5		
12Y			
15Y			
20Y			
CRS	3y 81		

TODAY KRX CCP	전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	103 건	40	63	145	155	84	89	52
금 액	30,095 억원	10,174	19,921	43,136	60,600	25,560	24,895	15,710

장중동향

국고채 금리, 금통위 대기중 외국인 수급 영향을 받으며 보합.

IRS, 단기 구간을 중심으로 비드우위에 상승.
장 후반 미 금리 하락에도, IRS 상승.

CRS, 대부분 구간 보합