

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

통화스왑, 장기적 효과에 대한 의문

금일 달러/원 예상 : 1,251.00~1,260.00

NDF 최종호가 : 1,253.00/1,253.50(+8.65)

야간달러선물 종가 : 1,249.30원 | 고가:1,252.30원 | 저가:1,238.10원

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD004	1240.00	▼45.2	26.0	680,229
USD005	1239.00	▼44.5	24.3	4,283
USD/KRW	1246.50	▼39.2	26.2	
USD/CNY	7.0674	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

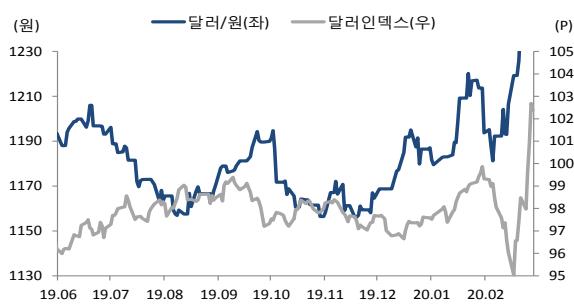
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	102.817	▲0.062	UST2Y	0.3134
EUR/USD	1.0688	▼0.0004	UST10Y	0.8454
USD/JPY	110.93	▲0.2200	UST30Y	1.4169
GBP/USD	1.1629	▲0.0144	WTI	22.43

차트. 달러/위안 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 달러인덱스 & 달러/원



출처 : Bloomberg , NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(03/21)	금 일(03/23)	익 일(03/24)
16:00 독일 2월 PPI YoY(결과:-0.1%, 이전:0.2%) 23:00 미국 2월 기준주택매매(결과:5.77m, 이전:5.46m)	23:30 미국 2월 시카고 연은 국가활동지수(예상:--, 이전:-0.25)	15:00 일본 2월 공작기계수주 YoY(F)(예상:--, 잠정:-30.1) 17:30 독일 3월 제조업 PMI(P)(예상:40.0, 잠정:48.0) 18:30 영국 3월 제조업 PMI(P)(예상:49.0, 이전:51.7) 22:45 미국 3월 제조업 PMI(P)(예상:45.0, 잠정:50.7) 23:00 미국 2월 신규주택매매 MoM(예상:-1.8%, 이전:7.9%) 23:00 미국 3월 리치몬드 연은 제조업지수(예상:-4, 이전:-2)

*주 : 예상 대비 호조(상승), 예상치 부합, 예상 대비 부진(하락), Bloomberg 컨센서스 기준

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD004	1,240.00	-45.20	1,257.00	1,263.90	1,237.90	26.00	444,096	-91,111	680,229	-12,535
USD005	1,239.00	-44.50	1,254.30	1,261.50	1,237.20	24.30	2,874	-2,315	4,283	774
USD SPOT	1,246.50	-39.20	1,253.70	1,264.20	1,238.00	26.20	8,035	164	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	79,889	101,524	-21,635	-32,578	-71,198
은행	6,148	4,353	1,795	-18,900	-29,496
투신	6,673	9,526	-2,853	9,868	77,068
보험	2,531	696	1,835	16,370	42,572
기타법인	38,753	15,869	22,884	34,324	27,450
개인	82,980	79,643	3,337	12,623	2,947
외국인	229,183	235,096	-5,913	-20,467	-48,055

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	1,566.15	108.51
국고채3Y	1.107	-0.086
국고채10Y	1.611	-0.046

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	52.203	1.192

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-5,839	-33,863	-135,254
KOSDAQ	591	3,703	-893
국고채	-2,117	21,827	46,612
통안채	182	2,365	6,417

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.750	0.000	1M	-1.90	1.60
Call	0.760	0.020	3M	-5.50	3.50
CD	1.020	0.000	6M	-10.10	7.90
통안1년	1.038	-0.014	12M	-15.50	12.50

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	19,173.98	-913.21	-4.55	-17.30
S&P	2,304.92	-104.47	-4.34	-14.98
나스닥	6,879.52	-271.06	-3.79	-12.64
FTSE 100	5,190.78	39.17	0.76	-3.27
DAX 30	8,928.95	318.52	3.70	-3.28
Nikkei 225	16,552.83	-173.72	-1.04	-10.81
Shanghai	2,745.62	43.49	1.61	-4.91
항셍 H	9,118.67	559.03	6.53	-5.51
미국채 2년	0.31	-0.14	-30.46	-36.08
미국채 10년	0.85	-0.30	-25.87	-11.97
WTI	22.43	-2.79	-11.06	-29.31
Gold	1,472.28	-16.10	-1.08	-7.70

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	-1.90	1.60
3M	-5.50	3.50
6M	-10.10	7.90
12M	-15.50	12.50

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	-0.515	0.935
2Y	-0.265	0.480
3Y	-0.215	0.350
4Y	-0.140	0.335
5Y	-0.100	0.285

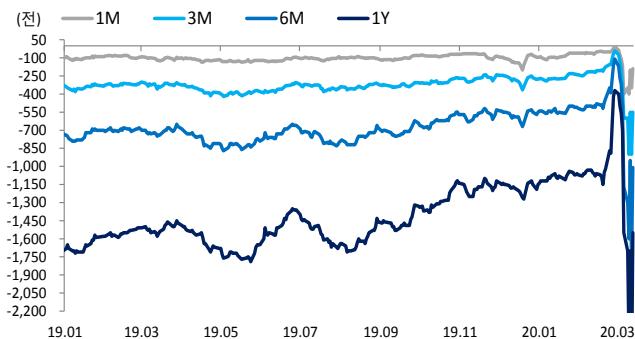
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화		기타 통화					
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	102.817	0.062	4.12	USD/KRW	1,248.05	-37.65	2.35
EUR/USD	1.0688	-0.0004	-3.77	USD/CNY	7.0960	-0.0126	1.25
USD/JPY	110.93	0.22	3.08	USD/HKD	7.7576	-0.0035	-0.20
GBP/USD	1.1629	0.0144	-5.29	USD/SGD	1.4506	-0.0003	2.52
USD/CHF	0.9869	0.0009	3.70	USD/TWD	30.261	-0.209	0.29
AUD/USD	0.5785	0.0042	-6.74	USD/INR	75.20	0.16	1.75
NZD/USD	0.5700	-0.0011	-5.85	USD/IDR	15,960	47	8.00
USD/CAD	1.4366	-0.0145	4.06	USD/THB	32.530	-0.050	2.29
USD/RUB	79.9771	0.8116	#N/A	USD/BRL	5.0640	-0.0321	4.75
USD/ZAR	17.6099	0.1430	8.20	USD/MXN	24.4189	0.3875	11.39
USD/PLN	4.2446	-0.0284	7.64	USD/TRY	6.5508	0.0074	3.44
USD/SEK	10.3899	-0.0268	7.01	USD/NOK	11.7051	0.4579	16.15

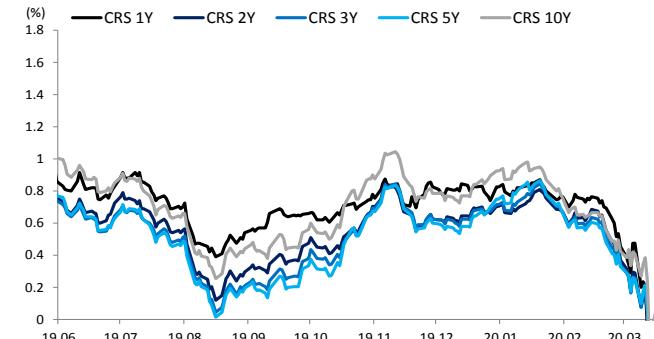
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



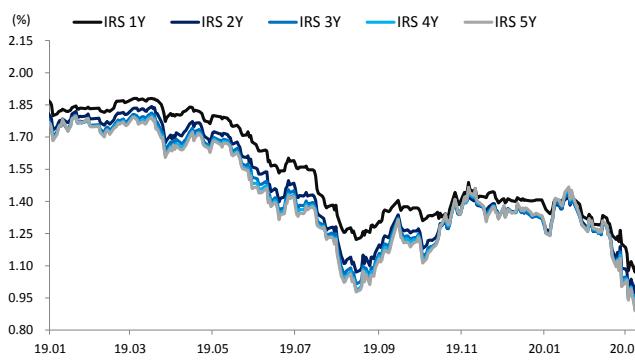
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



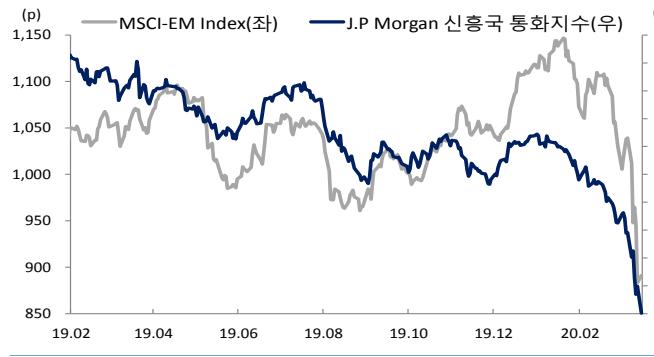
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



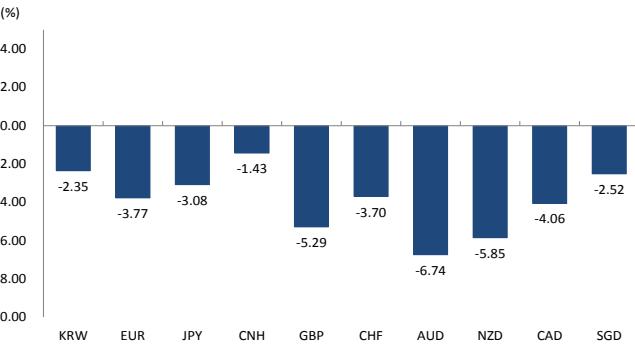
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



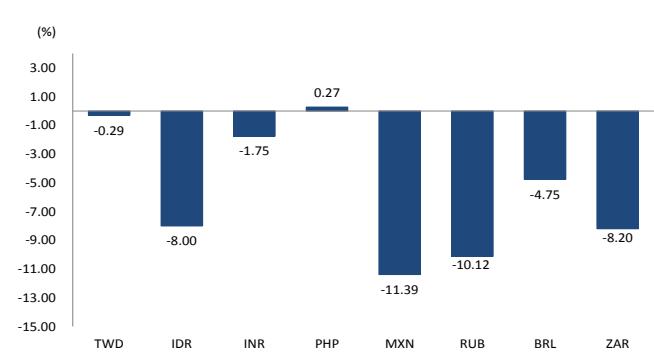
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터