

## FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

## 지표는 부진하지만 경제활동은 재개

금일 달러/원 예상 : 1,223.00~1,230.00

NDF 최종호가 : 1,227.20/1,227.80(+0.20)

야간달러선물 종가 : 1,228.60원 | 고가:1,230.20원 | 저가:1,225.50원

## ◇ 전일 국내시장 동향

| 종목      | 전일종가    | 전일비<br>(원) | 변동폭<br>(고가-저가) | 미결제약정<br>(계약) |
|---------|---------|------------|----------------|---------------|
| USD004  | 1229.00 | ▲12.0      | 3.7            | 282,120       |
| USD005  | 1225.10 | ▲9.1       | 3.7            | 416,562       |
| USD/KRW | 1228.70 | ▲11.4      | 4.2            |               |
| USD/CNY | 7.0809  | ▼0.0029    | 0.0083         |               |

## ◇ 전일 해외시장 동향

| 종목        | 전일종가    | 전일비(bp) | 종목     | 전일종가   |
|-----------|---------|---------|--------|--------|
| USD Index | 100.025 | ▲0.564  | UST2Y  | 0.2066 |
| EUR/USD   | 1.084   | ▼0.0070 | UST10Y | 0.6267 |
| USD/JPY   | 107.92  | ▲0.4600 | UST30Y | 1.2234 |
| GBP/USD   | 1.2457  | ▼0.0061 | WTI    | 19.95  |

## 차트. 달러/위안 &amp; 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/인덱스 &amp; 달러/원



출처 : Sina, NH선물 리서치센터

## 주요 경제지표 및 이벤트

| 전 일(04/16)                                    | 금 일(04/17)                               | 익 일(04/20)                                 |
|---|--|--|
| 18:00 유럽 2월 산업생산 MoM(결과:-0.1%, 이전:2.3%)       | 11:00 중국 1분기 GDP QoQ(예상:-6.0%, 이전:6.0%)  | 10:30 PBoC 1년만기 대출우대금리(예상:3.85%, 이전:4.05%) |
| 2130 미국 3월 주택착공건수 MoM(결과:1216k, 이전:1599k)     | 11:00 중국 3월 광공업생산 YoY(예상:-6.2%, 이전:--)   | 10:30 독일 3월 PPI YoY(예상:--%, 이전:-0.1%)      |
| 21:30 미국 3월 건축허가(결과:1353k, 이전:1464k)          | 11:00 중국 3월 소매판매 YoY(예상:-9.8%, 이전:--)    | 18:00 유럽 3월 CPI YoY(F)(예상:0.7%, 잠정:1.2%)   |
| 21:30 미국 4월 필라델피아 연준 경기전망(결과:-56.6, 이전:-12.7) | 18:00 유럽 3월 CPI YoY(F)(예상:0.7%, 잠정:1.2%) | 21:30 미국 시카고 연방 국가활동지수(예상:-0.62, 이전:0.16)  |
| 21:30 미국 주간 신규실업수당청구건수(결과:5245k, 이전:6606k)    | 23:00 미국 3월 선행지수 (예상:-7.2%, 이전:0.1%)     |  |

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

## USD Futures &amp; Spot

| 종목       | 종가       | 전일비   | 시가       | 고가       | 저가       | 변동폭  | 거래량     | 전일대비   | 미결제약정   | 전일대비     |
|----------|----------|-------|----------|----------|----------|------|---------|--------|---------|----------|
| USD004   | 1,229.00 | 12.00 | 1,225.80 | 1,229.00 | 1,225.30 | 3.70 | 271,837 | -4,143 | 282,120 | -192,207 |
| USD005   | 1,225.10 | 9.10  | 1,224.20 | 1,227.80 | 1,224.10 | 3.70 | 56,527  | 14,258 | 416,562 | 231,067  |
| USD SPOT | 1,228.70 | 11.40 | 1,224.90 | 1,229.10 | 1,224.90 | 4.20 | 0       | -6,544 | -       | -        |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

| 구분   | 매수      | 매도      | 순매수     | 5일누적    | 20일누적   |
|------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 금융투자 | 465,262 | 444,976 | 20,286  | 6,272   | 30,154  |
| 은행   | 78,684  | 75,584  | 3,100   | 2,795   | -35,960 |
| 투신   | 112,402 | 115,915 | -3,513  | -6,095  | -46,066 |
| 보험   | 54,657  | 54,911  | -254    | 73      | -206    |
| 기타법인 | 61,021  | 64,741  | -3,720  | 8,159   | 74,415  |
| 개인   | 48,256  | 58,647  | -10,391 | -16,903 | 20,803  |
| 외국인  | 245,055 | 250,363 | -5,308  | 6,374   | -43,223 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

| 종목     | 주가/금리    | 전일비    |
|--------|----------|--------|
| KOSPI  | 1,857.07 | -0.01  |
| 국고채3Y  | 0.982    | -0.014 |
| 국고채10Y | 1.411    | -0.053 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

| 만기     | Mid    | 전일비    |
|--------|--------|--------|
| CDS 5Y | 30.488 | -0.519 |

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

| 종목     | 순매수    | 5일 누적   | 20일누적   |
|--------|--------|---------|---------|
| KOSPI  | -5,687 | -11,266 | -67,902 |
| KOSDAQ | 714    | -587    | -5,934  |
| 국고채    | -3,681 | 6,810   | 27,224  |
| 통안채    | 248    | 5,056   | 19,693  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

| Korea | 종가    | 전일비   | US Libor | 종가      | 전일비      |
|-------|-------|-------|----------|---------|----------|
| 기준    | 0.750 | 0.000 | 1M       | 0.71825 | 0.03250  |
| Call  | 0.790 | 0.060 | 3M       | 1.13525 | -0.00037 |
| CD    | 1.100 | 0.000 | 6M       | 1.12500 | 0.02513  |
| 통안1년  | 0.855 | 0.000 | 12M      | 0.98125 | 0.03288  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

| 종목         | 종가        | 전일비     | 전일비(%) | 1주(%)  |
|------------|-----------|---------|--------|--------|
| 다우지수       | 23,537.68 | 33.33   | 0.14   | 0.44   |
| S&P        | 2,799.55  | 16.19   | 0.58   | 1.80   |
| 나스닥        | 8,532.36  | 139.19  | 1.66   | 5.46   |
| FTSE 100   | 5,628.43  | 30.78   | 0.55   | -1.33  |
| DAX 30     | 10,301.54 | 21.78   | 0.21   | -0.53  |
| Nikkei 225 | 19,290.20 | -259.89 | -1.33  | -0.29  |
| Shanghai   | 2,819.94  | 8.76    | 0.31   | -0.21  |
| 항셍 H       | 9,672.60  | -52.10  | -0.54  | -1.77  |
| 미국채 2년     | 0.21      | 0.01    | 4.93   | -8.34  |
| 미국채 10년    | 0.63      | -0.00   | -0.78  | -12.85 |
| WTI        | 19.95     | 0.08    | 0.40   | -12.35 |
| Gold       | 1,713.62  | -0.83   | -0.05  | 1.78   |

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

| 만기  | Mid    | 전일비   |
|-----|--------|-------|
| 1M  | -1.40  | -0.25 |
| 3M  | -4.20  | -0.70 |
| 6M  | -8.20  | -1.10 |
| 12M | -13.50 | -1.30 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

| 만기 | Mid    | 전일비    |
|----|--------|--------|
| 1Y | -0.295 | -0.170 |
| 2Y | -0.240 | -0.125 |
| 3Y | -0.205 | -0.125 |
| 4Y | -0.205 | -0.125 |
| 5Y | -0.210 | -0.125 |

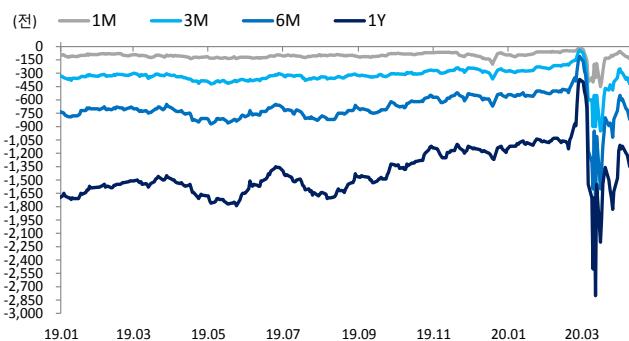
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

| 아시아 통화    |         |         | 기타 통화 |         |          |
|-----------|---------|---------|-------|---------|----------|
| 종목        | 종가      | 전일비     | 1주(%) | 종목      | 종가       |
| USD Index | 100.025 | 0.564   | 0.51  | USD/KRW | 1,228.70 |
| EUR/USD   | 1.0840  | -0.0070 | -0.82 | USD/CNY | 7.0814   |
| USD/JPY   | 107.92  | 0.46    | -0.53 | USD/HKD | 7.7511   |
| GBP/USD   | 1.2457  | -0.0061 | -0.01 | USD/SGD | 1.4279   |
| USD/CHF   | 0.9703  | 0.0057  | 0.43  | USD/TWD | 30.086   |
| AUD/USD   | 0.6327  | 0.0008  | -0.21 | USD/INR | 76.79    |
| NZD/USD   | 0.5968  | -0.0023 | -1.86 | USD/IDR | 15,640   |
| USD/CAD   | 1.4082  | -0.0033 | 0.76  | USD/THB | 32.670   |
|           |         |         |       |         |          |
|           |         |         |       | USD/RUB | 74.1739  |
|           |         |         |       | USD/BRL | 5.2342   |
|           |         |         |       | USD/ZAR | 18.8787  |
|           |         |         |       | USD/MXN | 24.0262  |
|           |         |         |       | USD/PLN | 4.1916   |
|           |         |         |       | USD/TRY | 6.9387   |
|           |         |         |       | USD/SEK | 10.0310  |
|           |         |         |       | USD/NOK | 10.4558  |

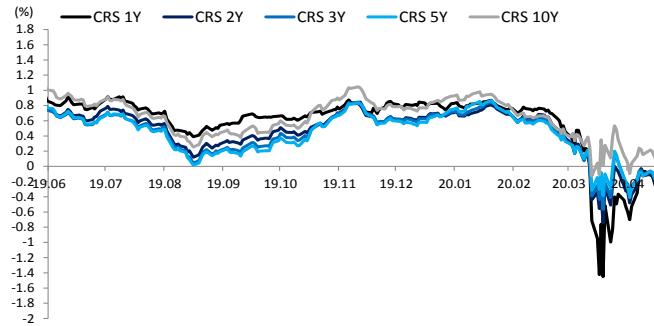
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



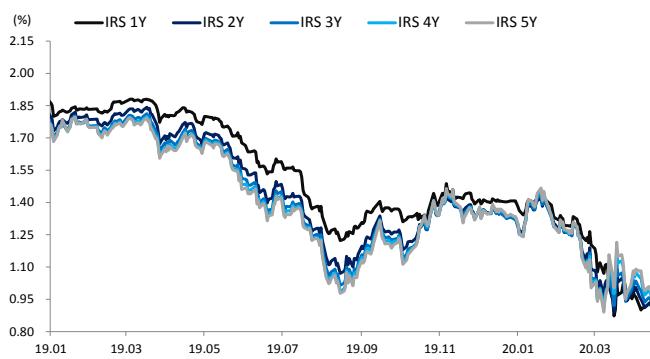
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



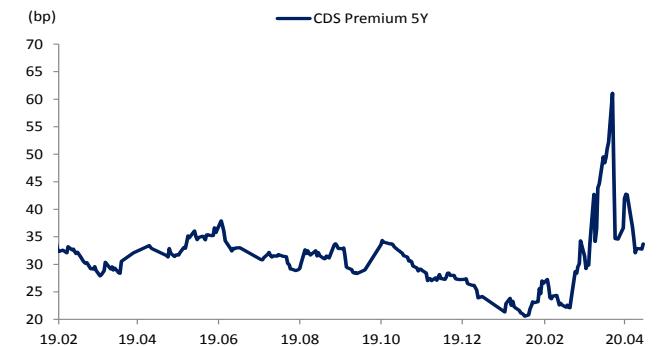
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



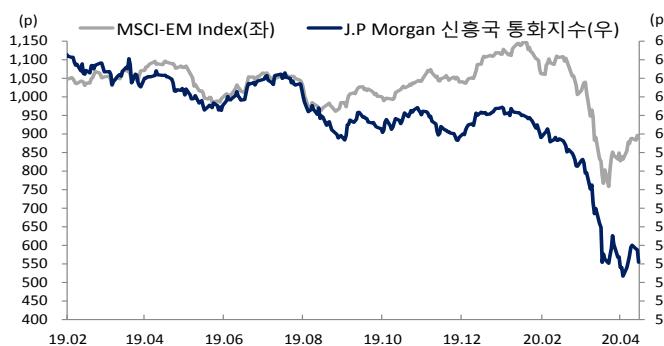
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



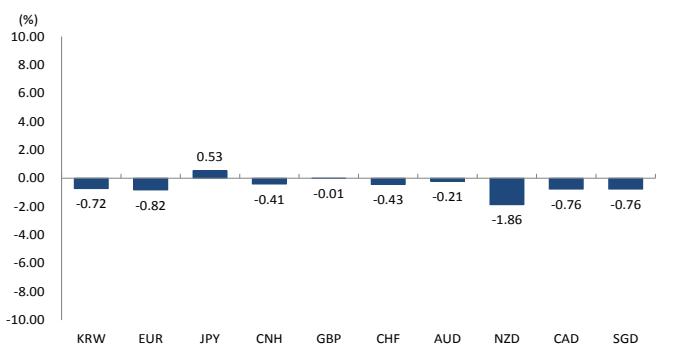
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



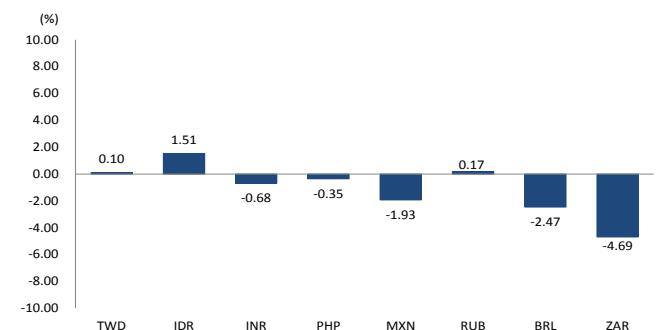
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터