

## FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

## ◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD008	1194.00	▲1.0	3.4	718,772
USD009	1193.90	▲0.8	3.1	13,875
USD/KRW	1194.10	▲0.7	3.4	
USD/CNY	6.9776	▼0.0029	0.0083	

## ◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.265	▼0.2770	UST2Y	0.1073
EUR/USD	1.1803	▲0.0041	UST10Y	0.5069
USD/JPY	105.72	▼0.2300	UST30Y	1.1857
GBP/USD	1.3071	▼0.0004	WTI	41.53

## 차트1. 달러/위안 &amp; 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트2. 달러/인덱스 &amp; 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 경제지표 및 이벤트

## 전 일(08/04)

- 13:30 호주 RBA 통화정책회의 기준금리결정(결과:동결)  
 23:00 미국 6월 제조업 수주 MoM(결과:6.2%, 이전:7.7%)  
 23:00 미국 6월 내구재 주문 MoM(F)(결과:7.3%, 잠정:7.3%)

## 금 일(08/05)

- 10:45 중국 7월 차이신 종합 PMI(예상:--, 이전:55.7)  
 16:55 독일 7월 마크 종합 PMI(F)(예상:55.5, 잠정:55.5)  
 17:00 유럽 7월 마크 종합 PMI(F)(예상:54.8, 잠정:54.8)  
 21:15 미국 7월 ADP비농업부문 고용자수(예상:1200k, 이전:2369k)  
 23:00 미국 7월 ISM서비스지수(예상:55.0, 이전:57.1)  
 (08/06)  
 06:00 미국 Fed 로버트 메스터(클리브랜드, 투표권)총재 연설

## 의 일(08/06)

- 15:00 영국 BOE 통화정책회의 기준금리결정(예상:동결)  
 15:00 독일 6월 제조업수주 MoM(예상:10.0%, 이전:10.4%)  
 21:30 미국 주간 신규 실업수당 청구(예상:1414k, 이전:1434k)  
 21:30 미국 실업보험 연속수급 신청(예상:16900k, 이전:17018k)  
 23:00 미국 Fed 로버트 카풀란(달러스, 투표권)총재 연설

\*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
USD008	1,194.00	1.00	1,192.00	1,195.10	1,191.70	3.40	174,254	-90,696	718,772	10,697
USD009	1,193.90	0.80	1,192.50	1,194.90	1,191.80	3.10	2,535	-1,593	13,875	-290
USD SPOT	1,194.10	0.70	1,192.20	1,195.00	1,191.60	3.40	4,818	-655	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	39,562	55,807	-16,245	-13,382	-16,750
은행	320	822	-502	-12,819	42,690
투신	906	1,415	-509	-12,308	-28,726
보험	-	198	-198	4,770	713
기타법인	1,861	2,367	-506	4,692	921
개인	20,094	23,228	-3,134	4,571	-10,441
외국인	115,900	94,806	21,094	24,486	10,007

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,279.97	28.93
국고채3Y	0.802	0.003
국고채10Y	1.306	0.000

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	23.481	0.164

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-583	1,356	15,302
KOSDAQ	-704	-466	-650
국고채	1,005	6,356	30,366
통안채	-1,413	-3,029	24,583

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14925	-0.00775
Call	0.470	0.000	3M	0.24850	-0.00050
CD	0.760	-0.020	6M	0.30550	0.00200
통안1년	0.598	0.002	12M	0.45088	0.00413

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	26,828.47	164.07	0.62	1.70
S&P	3,306.51	11.90	0.36	2.74
나스닥	10,941.17	38.37	0.35	5.18
FTSE 100	6,036.00	3.15	0.05	-1.52
DAX 30	12,600.87	-46.11	-0.36	-1.83
Nikkei 225	22,573.66	378.28	1.70	-0.37
Shanghai	3,371.69	3.72	0.11	4.45
항셍 H	10,203.88	170.68	1.70	0.51
미국채 2년	0.11	-0.00	-1.83	-22.64
미국채 10년	0.51	-0.05	-8.55	-12.45
WTI	41.53	0.52	1.27	1.19
Gold	1,999.67	28.93	1.47	2.71

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.05	0.00
3M	-0.55	0.00
6M	-1.20	0.00
12M	-3.30	0.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.000	0.005
2Y	-0.060	-0.010
3Y	-0.050	-0.010
4Y	-0.060	-0.020
5Y	-0.055	-0.035

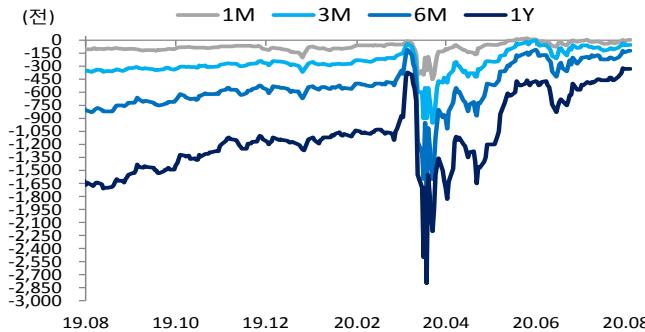
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.265	-0.277	-0.46	USD/KRW	1,194.05	0.70	-0.25	USD/RUB	73.5399	0.4176	1.31
EUR/USD	1.1803	0.0041	0.74	USD/CNY	6.9734	-0.0075	-0.39	USD/BRL	5.2865	-0.0355	2.51
USD/JPY	105.72	-0.23	0.60	USD/HKD	7.7500	-0.0005	-0.00	USD/ZAR	17.3842	0.1894	5.21
GBP/USD	1.3071	-0.0004	1.07	USD/SGD	1.3732	-0.0029	-0.42	USD/MXN	22.6701	0.0416	3.34
USD/CHF	0.9133	-0.0045	-0.50	USD/TWD	29.474	0.019	0.33	USD/PLN	3.7245	-0.0267	-1.11
AUD/USD	0.7160	0.0036	0.03	USD/INR	75.05	0.03	0.27	USD/TRY	6.8974	-0.0538	-0.55
NZD/USD	0.6622	0.0009	-0.59	USD/IDR	14,625	-5	0.62	USD/SEK	8.7193	-0.0293	-0.62
USD/CAD	1.3319	-0.0072	-0.46	USD/THB	31.090	-0.135	-1.92	USD/NOK	9.1166	-0.0146	-0.03

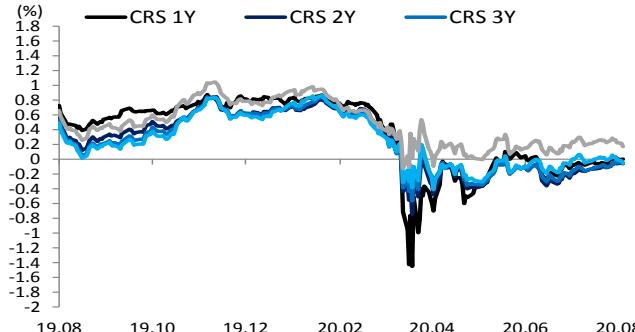
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



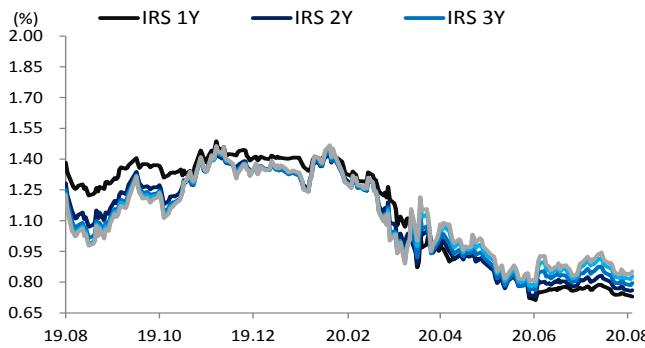
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



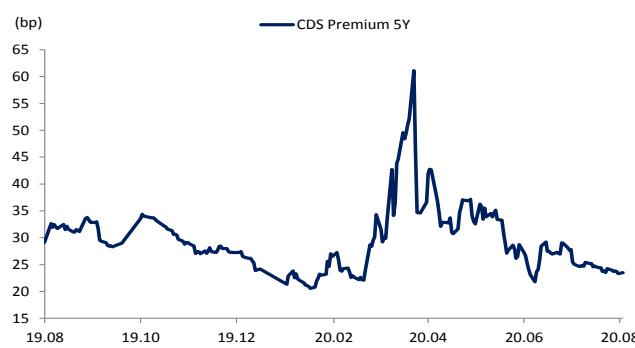
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



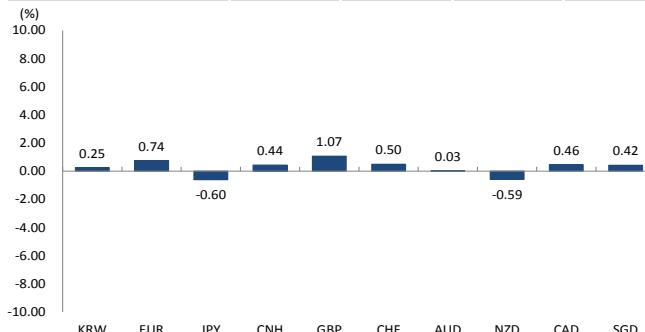
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



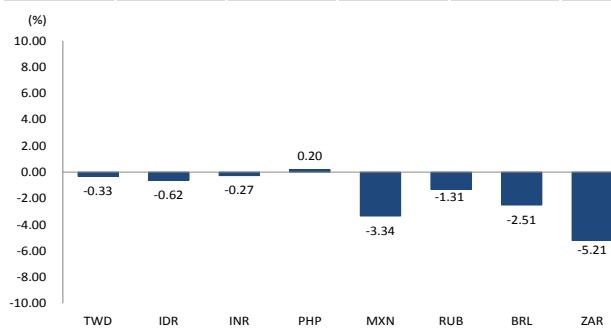
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터