

## FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

## ◇ 전일 국내시장 동향

| 종목      | 전일종가    | 전일비<br>(원) | 변동폭<br>(고가-저가) | 미결제약정<br>(계약) |
|---------|---------|------------|----------------|---------------|
| USD009  | 1184.00 | ▼0.5       | 2.6            | 742,052       |
| USD010  | 1183.80 | ▼0.8       | 2.2            | 699           |
| USD/KRW | 1183.70 | ▼0.9       | 2.7            |               |
| USD/CNY | 6.9295  | ▼0.0029    | 0.0083         |               |

## ◇ 전일 해외시장 동향

| 종목        | 전일종가   | 전일비(bp) | 종목     | 전일종가   |
|-----------|--------|---------|--------|--------|
| USD Index | 92.312 | ▼0.5390 | UST2Y  | 0.1431 |
| EUR/USD   | 1.1931 | ▲0.0061 | UST10Y | 0.6687 |
| USD/JPY   | 105.41 | ▼0.5900 | UST30Y | 1.3955 |
| GBP/USD   | 1.3239 | ▲0.0136 | WTI    | 42.89  |

## 차트1. 달러/원 &amp; 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트2. 달러/원 &amp; 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 경제지표 및 이벤트

## 전 일(08/18)

- 21:30 미국 7월 건축허가(결과:1495k, 예상:1258k)  
21:30 미국 7월 주택착공건수(결과:1496k, 예상:1220k)

## 금 일(08/19)

- 08:50 일본 6월 핵심기계수주 MoM(예상:2.0%, 이전:1.7%)  
15:00 영국 7월 CPI YoY(예상:0.6%, 이전:0.6%)  
18:00 유럽 7월 CPI YoY(F)(예상:0.4%, 잠정:0.3%)  
20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수(예상:--, 이전:6.8%)  
23:30 미국 DOE 주간원유재고(예상:-2850k, 이전:-4512k)  
(8/20)  
03:00 미국 FOMC 회의록 공개

## 의 일(08/20)

- 10:30 중국 LPR 대출우대금리 발표(예상:동결)  
15:00 독일 7월 PPI YoY(예상:-1.8%, 이전:-1.8%)  
21:30 미국 8월 필라델피아 연준 경기전망(예상:21.0, 이전:24.1)  
21:30 미국 주간 신규 실업수당 청구건수(예상:920k, 이전:963k)  
23:00 미국 7월 컨퍼런스보드 선행지수(예상:1.1%, 이전:2.0%)  
(08/21)  
02:00 미국 Fed 메리 데일리(샌프란시스코, 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    |
|----------|----------|-------|----------|----------|----------|------|---------|--------|---------|---------|
| USD009   | 1,184.00 | -0.50 | 1,185.00 | 1,186.40 | 1,183.80 | 2.60 | 260,766 | 45,819 | 742,052 | -10,876 |
| USD010   | 1,183.80 | -0.80 | 1,184.20 | 1,186.00 | 1,183.80 | 2.20 | 731     | 722    | 699     | 457     |
| USD SPOT | 1,183.70 | -0.90 | 1,183.60 | 1,186.30 | 1,183.60 | 2.70 | 5,230   | -419   | -       | -       |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

| 구분   | 매수      | 매도      | 순매수     | 5일누적    | 20일누적   |
|------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 금융투자 | 62,524  | 73,990  | -11,466 | -39,168 | -82,171 |
| 은행   | 1,917   | 1,850   | 67      | -2,278  | 21,939  |
| 투신   | 20,828  | 1,209   | 19,619  | 31,930  | 11,655  |
| 보험   | -       | 518     | -518    | -1,443  | 7       |
| 기타법인 | 6,404   | 7,543   | -1,139  | 2,105   | 18,587  |
| 개인   | 24,132  | 16,846  | 7,286   | 5,304   | 25,958  |
| 외국인  | 145,712 | 159,561 | -13,849 | 3,540   | 4,025   |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

| 종목     | 주가/금리    | 전일비    |
|--------|----------|--------|
| KOSPI  | 2,348.24 | -59.25 |
| 국고채3Y  | 0.810    | -0.018 |
| 국고채10Y | 1.357    | -0.039 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

| 만기     | Mid    | 전일비   |
|--------|--------|-------|
| CDS 5Y | 21.830 | 0.012 |

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

| 종목     | 순매수   | 5일 누적  | 20일누적  |
|--------|-------|--------|--------|
| KOSPI  | 733   | -7,377 | 11,006 |
| KOSDAQ | -936  | -1,393 | -137   |
| 국고채    | 165   | 5,505  | 29,524 |
| 통안채    | 4,692 | 8,326  | 19,798 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

| Korea | 종가    | 전일비    | US Libor | 종가      | 전일비      |
|-------|-------|--------|----------|---------|----------|
| 기준    | 0.500 | 0.000  | 1M       | 0.15800 | -0.00338 |
| Call  | 0.600 | -0.030 | 3M       | 0.25300 | -0.01475 |
| CD    | 0.640 | -0.010 | 6M       | 0.31525 | -0.00438 |
| 통안1년  | 0.611 | -0.007 | 12M      | 0.44713 | -0.01325 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

| 종목         | 종가        | 전일비    | 전일비(%) | 1주(%) |
|------------|-----------|--------|--------|-------|
| 다우지수       | 27,778.07 | -66.84 | -0.24  | 0.33  |
| S&P        | 3,389.78  | 7.79   | 0.23   | 1.68  |
| 나스닥        | 11,210.84 | 81.11  | 0.73   | 3.97  |
| FTSE 100   | 6,076.62  | -50.82 | -0.83  | -1.26 |
| DAX 30     | 12,881.76 | -38.90 | -0.30  | -0.50 |
| Nikkei 225 | 23,051.08 | -45.67 | -0.20  | 1.32  |
| Shanghai   | 3,451.09  | 12.29  | 0.36   | 3.32  |
| 항셍 H       | 10,425.42 | 39.52  | 0.38   | 2.68  |
| 미국채 2년     | 0.14      | -0.01  | -5.29  | -3.90 |
| 미국채 10년    | 0.67      | -0.02  | -2.83  | 4.24  |
| WTI        | 42.89     | 0.00   | 0.00   | 3.08  |
| Gold       | 2,006.91  | 19.48  | 0.98   | 3.34  |

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

| 만기  | Mid   | 전일비  |
|-----|-------|------|
| 1M  | -0.10 | 0.05 |
| 3M  | -0.50 | 0.05 |
| 6M  | -1.20 | 0.00 |
| 12M | -3.00 | 0.00 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

| 만기 | Mid    | 전일비    |
|----|--------|--------|
| 1Y | 0.040  | -0.020 |
| 2Y | -0.045 | -0.015 |
| 3Y | -0.035 | -0.015 |
| 4Y | -0.030 | -0.015 |
| 5Y | -0.010 | -0.015 |

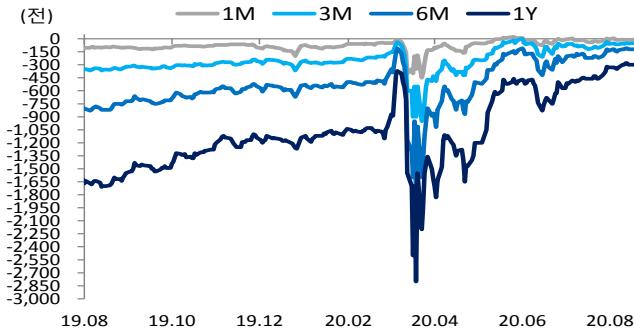
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

| 아시아 통화    |        |         |       |         | 기타 통화    |         |       |         |         |         |       |
|-----------|--------|---------|-------|---------|----------|---------|-------|---------|---------|---------|-------|
| 종목        | 종가     | 전일비     | 1주(%) | 종목      | 종가       | 전일비     | 1주(%) | 종목      | 종가      | 전일비     | 1주(%) |
| USD Index | 92.312 | -0.539  | -1.41 | USD/KRW | 1,183.70 | -0.90   | -0.16 | USD/RUB | 73.1693 | -0.5327 | 0.05  |
| EUR/USD   | 1.1931 | 0.0061  | 1.63  | USD/CNY | 6.9218   | -0.0111 | -0.35 | USD/BRL | 5.4679  | -0.0433 | 1.61  |
| USD/JPY   | 105.41 | -0.59   | -1.01 | USD/HKD | 7.7502   | -0.0003 | 0.00  | USD/ZAR | 17.3199 | -0.1953 | -0.88 |
| GBP/USD   | 1.3239 | 0.0136  | 1.46  | USD/SGD | 1.3646   | -0.0033 | -0.64 | USD/MXN | 22.1681 | -0.0306 | -1.04 |
| USD/CHF   | 0.9038 | -0.0028 | -1.42 | USD/TWD | 29.450   | -0.018  | -0.04 | USD/PLN | 3.6687  | -0.0361 | -2.27 |
| AUD/USD   | 0.7243 | 0.0029  | 1.40  | USD/INR | 74.76    | -0.13   | -0.02 | USD/TRY | 7.3739  | -0.0082 | 2.07  |
| NZD/USD   | 0.6601 | 0.0043  | 0.36  | USD/IDR | 14,845   | 50      | 1.12  | USD/SEK | 8.6476  | -0.0425 | -1.27 |
| USD/CAD   | 1.3168 | -0.0047 | -1.00 | USD/THB | 31.132   | -0.073  | 0.23  | USD/NOK | 8.8463  | -0.0041 | -1.93 |

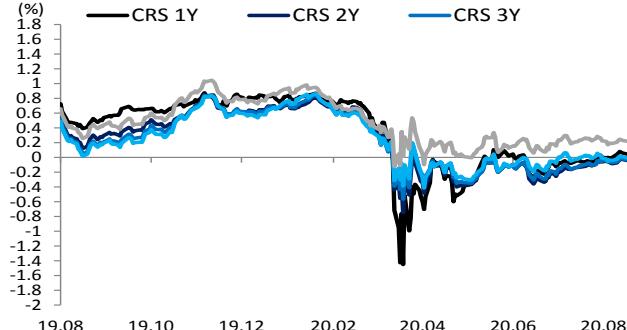
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



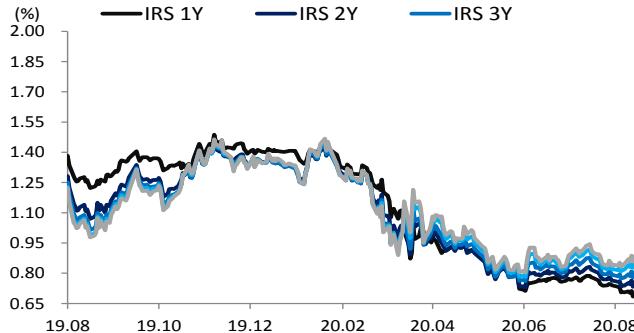
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



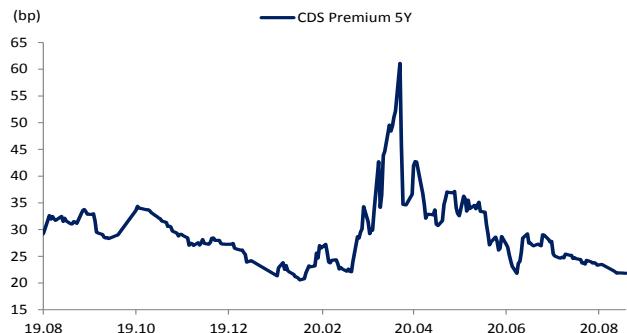
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



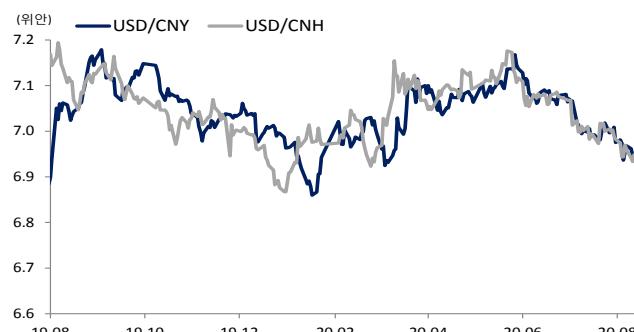
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



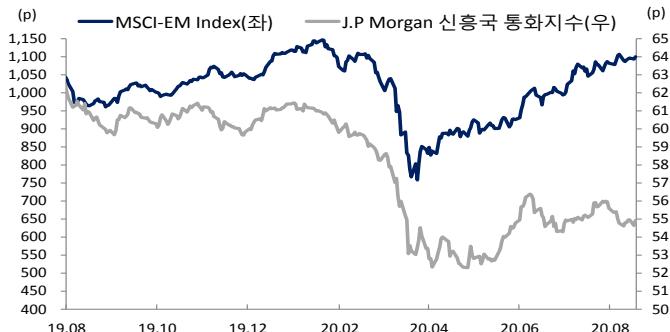
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



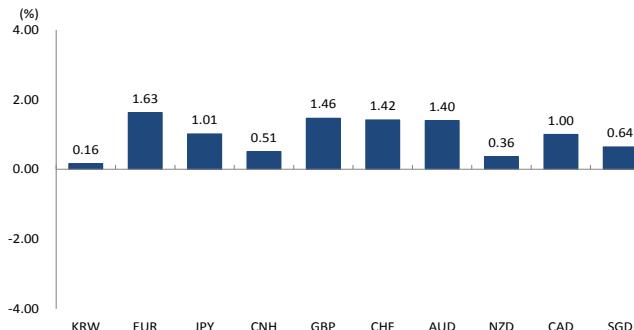
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



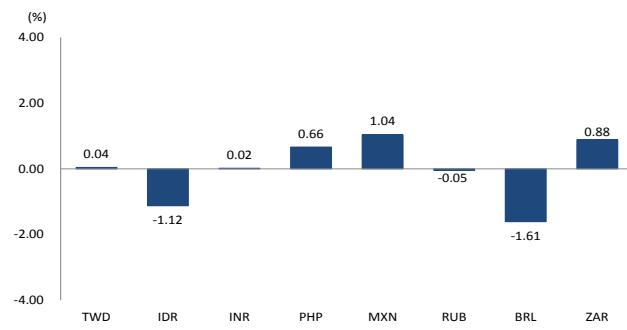
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터