

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD009	1186.60	▲5.7	4.9	739,882
USD010	1186.30	▲4.9	4.2	1,311
USD/KRW	1186.90	▲5.7	4.4	
USD/CNY	6.9194	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

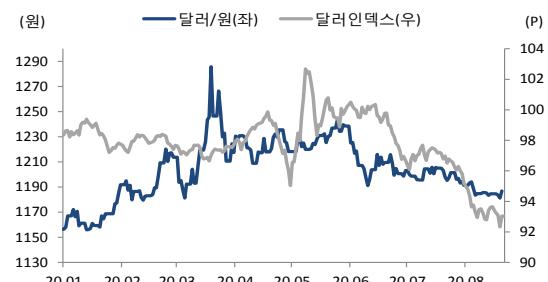
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	92.745	▼0.1420	UST2Y	0.1411
EUR/USD	1.1860	▲0.0022	UST10Y	0.6509
USD/JPY	105.80	▼0.3200	UST30Y	1.3833
GBP/USD	1.3214	▲0.0116	WTI	42.58

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(08/20)

- 21:30 미국 8월 필라델피아 연준 경기전망(결과:17.2, 이전:24.1)
 21:30 미국 주간 신규 실업수당 청구건수(결과:1106k, 이전:971k)
 23:00 미국 7월 컨퍼런스보드 선행지수(결과:1.4%, 이전:3.0%)
 (08/21)
 02:00 미국 Fed 메리 데일리(샌프란시스코, 투표권)총재 연설

금 일(08/21)

- 08:01 영국 8월 Gfk 소비자기대지수(P)(예상:-25, 이전:-27)
 09:00 한국 8월 수출 20일 YoY(예상:--, 이전:-12.8%)
 15:00 영국 7월 소매판매 MoM(예상:0.2%, 이전:13.5%)
 16:30 독일 8월 마켓 제조업 PMI(P)(예상:52.3, 이전:51.0)
 17:00 유럽 8월 마켓 제조업 PMI(P)(예상:52.7, 이전:51.8)
 22:45 미국 8월 마켓 제조업 PMI(P)(예상:52.0, 이전:50.9)
 23:00 유럽 8월 소비자기대지수(예상:-15.0, 이전:-15.0)

의 일(08/24)

- 21:30 미국 7월 시카고 연준 국가활동지수(예상:3.88, 이전:4.11)
 (08/25)
 06:00 한국 8월 소비자심리지수(예상:--, 이전:4.11)

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD009	1,186.60	5.70	1,183.50	1,188.10	1,183.20	4.90	289,902	43,918	739,882	-15,141
USD010	1,186.30	4.90	1,183.50	1,187.70	1,183.50	4.20	958	396	1,311	537
USD SPOT	1,186.90	5.70	1,184.00	1,188.20	1,183.80	4.40	6,104	463	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	73,803	90,974	-17,171	-5,394	-72,620
은행	3,229	360	2,869	4,464	18,182
투신	1,400	993	407	20,324	3,537
보험	255	230	25	-1,801	170
기타법인	6,543	13,627	-7,084	-6,386	7,288
개인	24,190	38,894	-14,704	-4,232	11,579
외국인	182,525	146,867	35,658	-6,445	31,864

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,274.22	-86.32
국고채3Y	0.813	0.008
국고채10Y	1.379	0.032
신용지표		
만기	Mid	전일비
CDS 5Y	21.723	-0.283

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-2,728	-12,699	1,175
KOSDAQ	-1,878	-555	-2,333
국고채	-298	7,933	28,484
통안채	1,201	9,749	21,185

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.18325	0.01237
Call	0.620	0.150	3M	0.25613	0.00925
CD	0.630	0.000	6M	0.29863	-0.00587
통안1년	0.618	0.007	12M	0.44063	-0.00425

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,739.73	46.85	0.17	-0.56
S&P	3,385.51	10.66	0.32	0.36
나스닥	11,264.95	118.49	1.06	2.01
FTSE 100	6,013.34	-98.64	-1.61	-2.79
DAX 30	12,830.00	-147.33	-1.14	-1.26
Nikkei 225	22,880.62	-229.99	-1.00	-1.59
Shanghai	3,363.90	-44.23	-1.30	1.30
항셍 H	10,155.81	-157.50	-1.53	-0.87
미국채 2년	0.14	0.00	1.44	-13.38
미국채 10년	0.65	-0.03	-4.29	-9.70
WTI	42.58	-0.35	-0.82	0.80
Gold	1,944.24	-19.87	-1.01	-0.50

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	-0.15	-0.05
3M	-0.55	-0.05
6M	-1.30	-0.10
12M	-3.10	-0.10
CRS		
만기	Mid	전일비
1Y	0.025	-0.015
2Y	-0.080	-0.010
3Y	-0.075	-0.005
4Y	-0.080	-0.010
5Y	-0.065	-0.010

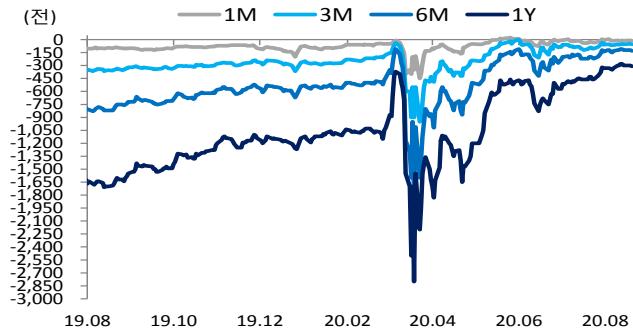
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	92.745	-0.142	-0.63	USD/KRW	1,187.00	5.65	0.31	USD/RUB	73.7986	0.5029	1.17
EUR/USD	1.1860	0.0022	0.39	USD/CNY	6.9158	-0.0049	-0.42	USD/BRL	5.5590	0.0017	3.52
USD/JPY	105.80	-0.32	-1.06	USD/HKD	7.7500	-0.0002	-0.01	USD/ZAR	17.2712	-0.0032	-0.83
GBP/USD	1.3214	0.0116	1.12	USD/SGD	1.3671	-0.0030	-0.42	USD/MXN	22.0759	-0.0331	-0.41
USD/CHF	0.9077	-0.0075	-0.22	USD/TWD	29.452	0.011	-0.05	USD/PLN	3.6963	-0.0210	-0.73
AUD/USD	0.7192	0.0010	0.60	USD/INR	75.03	0.21	0.25	USD/TRY	7.2981	0.0105	-0.55
NZD/USD	0.6535	-0.0024	-0.18	USD/IDR	14,773	-72	0.09	USD/SEK	8.7091	0.0040	0.24
USD/CAD	1.3186	-0.0030	-0.28	USD/THB	31.440	0.215	1.21	USD/NOK	8.9207	-0.0081	0.43

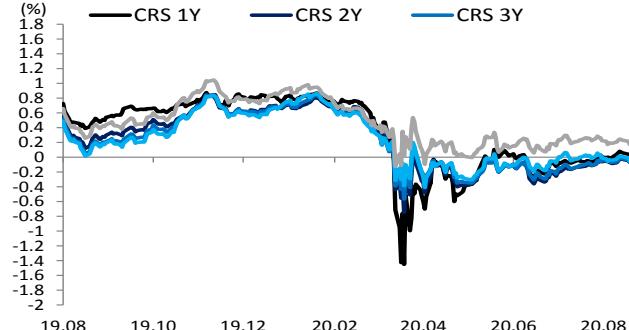
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



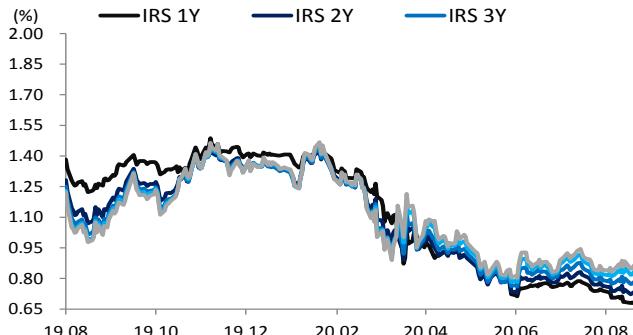
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



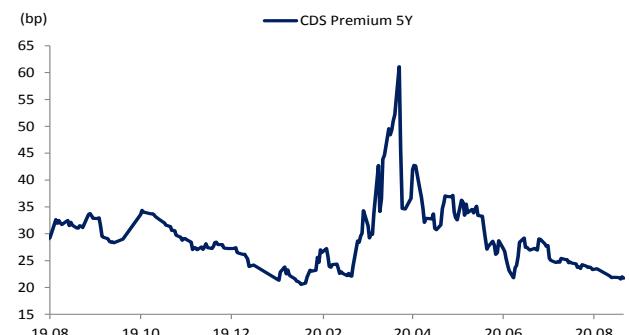
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



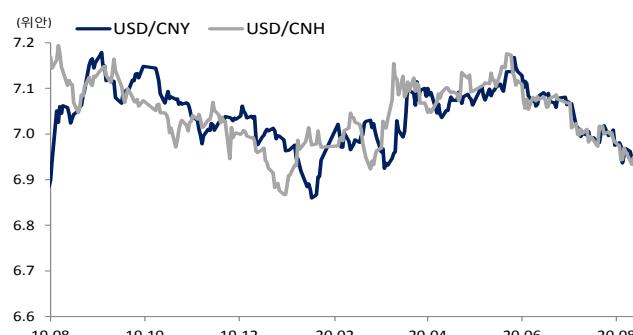
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



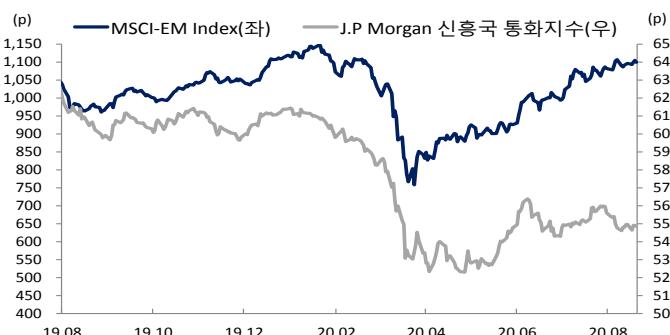
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



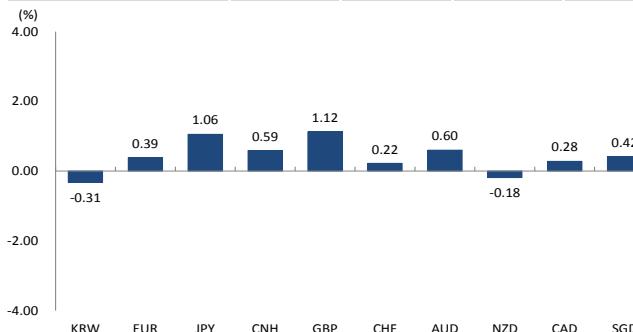
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



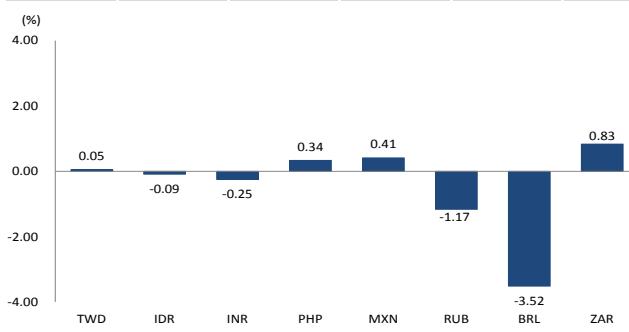
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터