

## FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

## ◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD009	1189.90	▲4.0	4.3	770,632
USD010	1188.90	▲2.6	4.2	3,748
USD/KRW	1189.10	▲2.8	4.6	
USD/CNY	6.9193	▼0.0029	0.0083	

## ◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.294	▲0.0470	UST2Y	0.1513
EUR/USD	1.1788	▼0.0009	UST10Y	0.6542
USD/JPY	105.98	▲0.1800	UST30Y	1.3559
GBP/USD	1.3063	▼0.0027	WTI	42.39

## 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(08/24)

21:30 미국 7월 시카고 연준 국가활동지수(결과:1.18, 이전:5.33)  
(08/25)

06:00 한국 8월 소비자심리지수(결과:88.2, 이전:84.2)

## 금 일(08/25)

15:00 독일 2분기 GDP QoQ(F)(예상:-10.1%, 이전:-10.1%)  
17:00 독일 8월 IFO 기업환경지수(예상:92.4, 이전:90.5)  
23:00 미국 8월 CB 소비자기대지수(예상:93, 이전:92.6)  
23:00 미국 7월 신규주택매매(예상:775k, 이전:776k)  
23:00 미국 8월 리치몬드 연은 제조업지수(예상:10, 이전:10)  
(8/26)  
06:00 한국 9월 기업경기실사 제조업(예상:--, 이전:57)

## 의 일(08/26)

15:45 프랑스 8월 소비자기대지수(예상:94, 이전:94)  
20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수 WoW(예상:--, 이전:-3.3%)  
21:30 미국 7월 내구재주문 MoM(P)(예상:4.5%, 이전:7.6%)  
23:30 미국 DOE 주간원유재고(예상:--, 이전:1632k)

\*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	1,189.90	4.00	1,191.70	1,192.70	1,188.40	4.30	226,476	-34,165	770,632	14,294
USD010	1,188.90	2.60	1,191.10	1,192.50	1,188.30	4.20	316	-1,104	3,748	2,242
USD SPOT	1,189.10	2.80	1,191.50	1,192.70	1,188.10	4.60	5,206	-510	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	63,040	53,068	9,972	11,851	-30,366
은행	1,354	1,240	114	6,139	17,804
투신	1,510	1,470	40	18,947	9,755
보험	119	16	103	-1,804	163
기타법인	6,076	5,121	955	-7,341	8,991
개인	20,780	22,104	-1,324	-3,744	16,360
외국인	139,081	148,941	-9,860	-24,048	-22,707

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,329.83	25.24
국고채3Y	0.824	-0.030
국고채10Y	1.378	-0.032

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	21.948	-0.058

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	1,976	-714	6,283
KOSDAQ	1,663	207	242
국고채	-2,977	-1,631	18,955
통안채	5,063	13,068	26,261

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.17425	-0.00088
Call	0.480	-0.140	3M	0.23375	-0.01625
CD	0.630	0.000	6M	0.29738	-0.01700
통안1년	0.625	-0.010	12M	0.43913	-0.00187

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	28,308.46	378.13	1.35	1.66
S&P	3,431.28	34.12	1.00	1.46
나스닥	11,379.72	67.92	0.60	2.25
FTSE 100	6,104.73	102.84	1.71	-0.37
DAX 30	13,066.54	301.74	2.36	1.13
Nikkei 225	22,985.51	65.21	0.28	-0.48
Shanghai	3,385.64	4.95	0.15	-1.55
항셍 H	10,336.95	124.74	1.22	-0.47
미국채 2년	0.15	0.01	5.66	0.13
미국채 10년	0.65	0.03	4.14	-4.94
WTI	42.39	0.05	0.12	-1.17
Gold	1,931.60	-8.88	-0.46	-2.81

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	-0.10	0.00
3M	-0.50	0.00
6M	-1.10	0.10
12M	-3.00	0.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.035	0.005
2Y	-0.065	0.005
3Y	-0.055	0.005
4Y	-0.055	0.005
5Y	-0.035	0.010

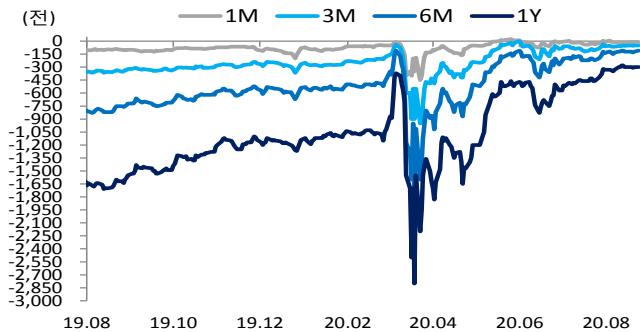
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.294	0.047	0.48	USD/KRW	1,189.15	2.85	0.46	USD/RUB	74.6519	-0.1415	1.29
EUR/USD	1.1788	-0.0009	-0.69	USD/CNY	6.9196	0.0002	-0.19	USD/BRL	5.6111	-0.0091	1.81
USD/JPY	105.98	0.18	-0.02	USD/HKD	7.7501	-0.0001	-0.01	USD/ZAR	16.9699	-0.1858	-3.11
GBP/USD	1.3063	-0.0027	-0.31	USD/SGD	1.3707	-0.0010	0.20	USD/MXN	21.9985	0.0236	-0.90
USD/CHF	0.9119	0.0003	0.58	USD/TWD	29.441	-0.001	-0.09	USD/PLN	3.7276	-0.0150	0.62
AUD/USD	0.7163	0.0002	-0.71	USD/INR	74.32	-0.52	-0.75	USD/TRY	7.3764	0.0601	-0.08
NZD/USD	0.6527	-0.0014	-0.47	USD/IDR	14,671	-102	-0.84	USD/SEK	8.7927	-0.0028	1.18
USD/CAD	1.3218	0.0041	0.02	USD/THB	31.465	-0.087	0.83	USD/NOK	8.9980	-0.0143	1.67

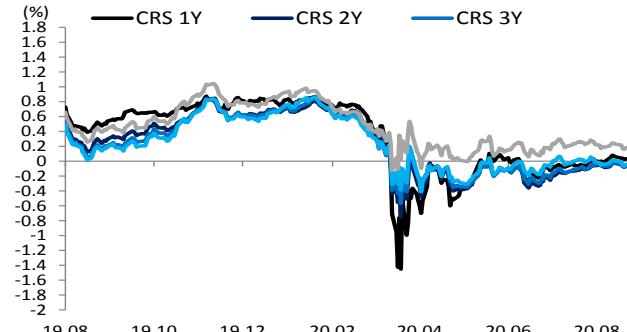
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



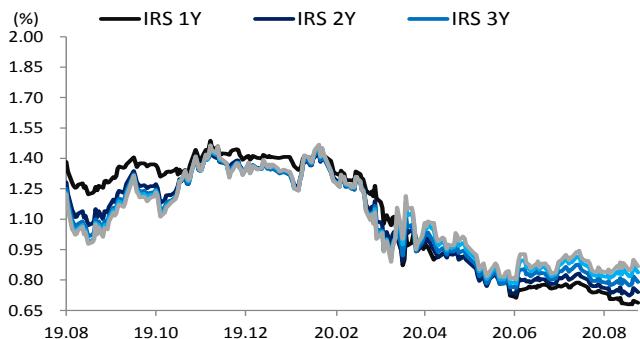
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



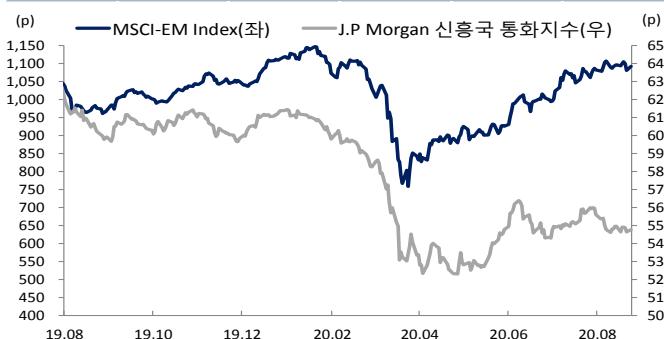
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



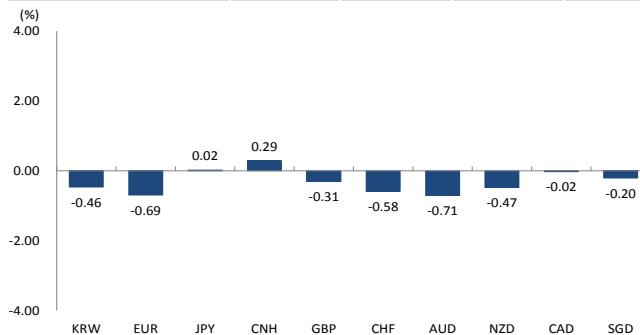
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



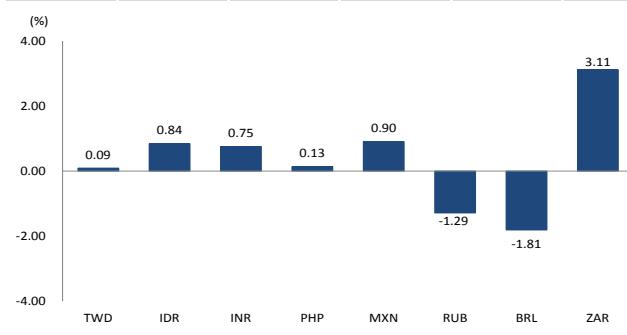
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터