

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD009	1187.20	▲3.5	9.7	755,332
USD010	1187.10	▲3.5	9.4	6,905
USD/KRW	1187.80	▲3.5	8.8	
USD/CNY	6.8593	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	92.172	▼0.1990	UST2Y	0.1309
EUR/USD	1.1936	▲0.0033	UST10Y	0.7048
USD/JPY	105.91	▲0.5400	UST30Y	1.4747
GBP/USD	1.3370	▲0.0017	WTI	42.61

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(08/31)

- 21:00 독일 8월 CPI YoY(P)(결과:0.1%, 이전:-0.1%)
- 22:00 미국 Fed 리처드 클라리다 부의장 연설
- 23:30 미국 8월 달러스 연준 제조업 활동(결과:8.0, 이전:-3.0)
- 23:30 미국 Fed 라파엘 보스틱(애틀란타, 투표권)총재 연설

금 일(09/01)

- 08:00 한국 2분기 GDP QoQ(F)(예상:-3.3%, 잠정:-3.3%)
- 10:45 중국 8월 차이신 제조업 PMI(예상:52.5, 이전:52.8)
- 13:30 호주 RBA 통화정책회의 기준금리결정(예상:기준금리 동결)
- 16:55 독일 8월 마켓 제조업 PMI(F)(예상:53.0, 잠정:53.0)
- 18:00 유럽 8월 CPI YoY(예상:0.2%, 이전:0.4%)
- 22:45 미국 8월 마켓 제조업 PMI(F)(예상:--, 잠정:53.6)
- 23:00 미국 8월 ISM 제조업지수(예상:54.4, 이전:54.2)

의 일(09/02)

- 21:15 미국 8월 ADP취업자 변동(예상:950k, 이전:167k)
- 23:00 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권) 연설
- 23:30 미국 DOE 주간 원유재고(예상:--, 이전:4689k)(09/03)
- 02:00 독일 엔스 바이트만 분데스방크 총재 연설
- 03:00 미국 Fed 베이지북 공개
- 04:00 미국 Fed 날 카시카리(미니애폴리스, 투표권) 연설

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

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD009	1,187.20	3.50	1,180.80	1,188.70	1,179.00	9.70	261,332	5,725	755,332	-16,842
USD010	1,187.10	3.50	1,181.00	1,188.30	1,178.90	9.40	6,444	1,862	6,905	97
USD SPOT	1,187.80	3.50	1,180.80	1,187.90	1,179.10	8.80	6,580	826	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	52,786	72,017	-19,231	-27,851	-65,841
은행	3,012	2,400	612	1,391	17,907
투신	716	824	-108	-90	4,008
보험	210	2,018	-1,808	-4,628	-9,564
기타법인	7,525	9,590	-2,065	2,145	4,181
개인	20,510	33,038	-12,528	2,573	8,463
외국인	184,055	148,927	35,128	26,500	40,876

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,326.17	-27.63
국고채3Y	0.940	0.047
국고채10Y	1.516	0.030

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	-16,326	-15,334	-28,321
KOSDAQ	2,444	1,328	1,088
국고채	5,595	2,547	13,369
통안채	1,099	-361	23,424

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	휴장	
Call	0.650	0.170	3M	휴장	
CD	0.630	0.000	6M	휴장	
통안1년	0.691	0.020	12M	휴장	

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	28,430.05	-223.82	-0.78	0.43
S&P	3,500.31	-7.70	-0.22	2.01
나스닥	11,775.46	79.83	0.68	3.48
FTSE 100	5,963.57	-36.42	-0.61	-0.64
DAX 30	12,945.38	-87.82	-0.67	-0.93
Nikkei 225	23,139.76	257.11	1.12	0.67
Shanghai	3,395.68	-8.13	-0.24	0.30
항셍 H	9,991.48	-191.35	-1.88	-3.34
미국채 2년	0.13	0.00	3.07	-13.48
미국채 10년	0.70	-0.02	-2.26	7.73
WTI	42.61	-0.36	-0.84	-0.02
Gold	1,971.90	7.07	0.36	2.09

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	-0.05	-0.05
3M	-0.35	0.05
6M	-0.90	0.10
12M	-2.50	0.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.110	0.010
2Y	0.025	0.010
3Y	0.025	0.005
4Y	0.025	0.005
5Y	0.055	0.005

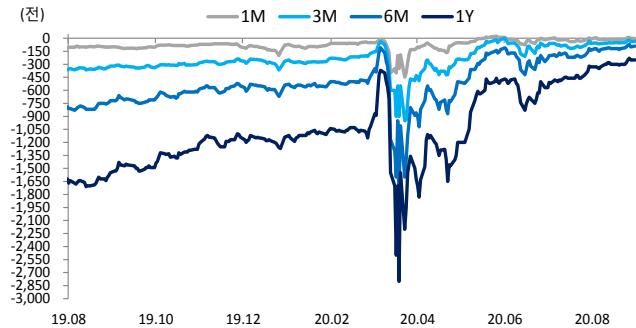
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화				
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가
USD Index	92.172	-0.199	-1.21	USD/KRW	1,187.85	3.45	-0.11	USD/RUB	74.0681
EUR/USD	1.1936	0.0033	1.26	USD/CNY	6.8485	-0.0169	-1.03	USD/BRL	5.4945
USD/JPY	105.91	0.54	-0.07	USD/HKD	7.7502	-0.0002	0.00	USD/ZAR	16.9416
GBP/USD	1.3370	0.0017	2.35	USD/SGD	1.3603	0.0022	-0.76	USD/MXN	21.8867
USD/CHF	0.9037	-0.0005	-0.90	USD/TWD	29.425	-0.010	-0.05	USD/PLN	3.6843
AUD/USD	0.7376	0.0011	2.97	USD/INR	73.62	0.22	-0.94	USD/TRY	7.3443
NZD/USD	0.6733	-0.0010	3.16	USD/IDR	14,563	-69	-0.74	USD/SEK	8.6454
USD/CAD	1.3047	-0.0052	-1.29	USD/THB	31.118	-0.042	-1.10	USD/NOK	8.7240

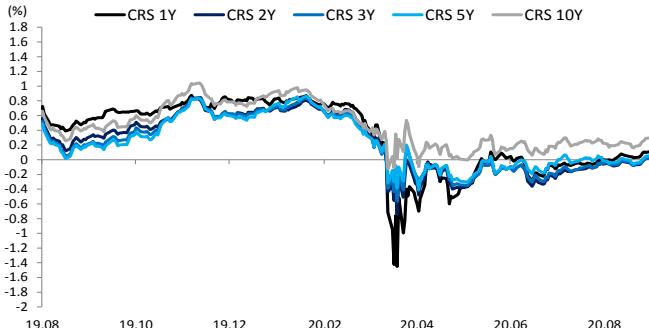
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



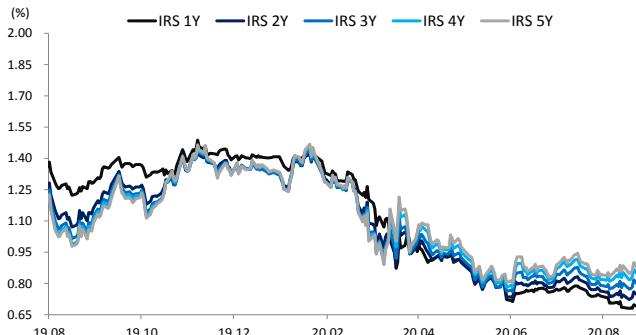
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



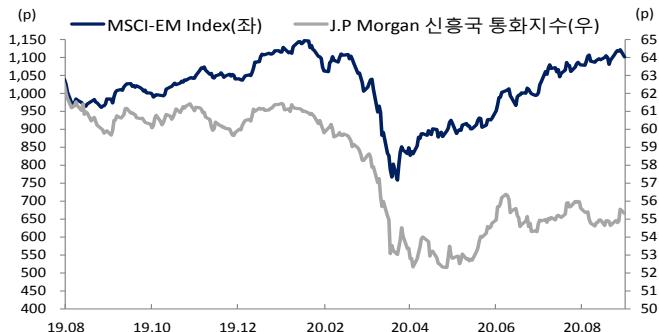
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



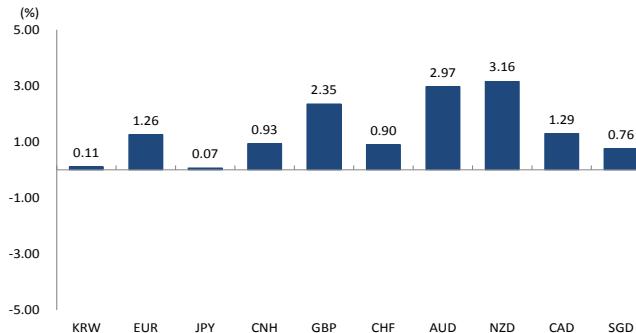
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



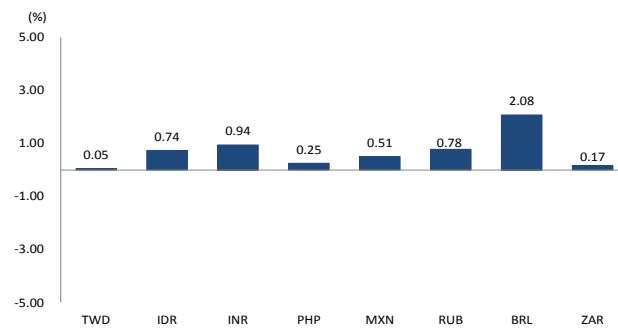
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터