

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

| 종목 | 전일종가 | 전일비 (원) | 변동폭 (고가-저가) | 미결제약정 (계약) |
|---------|---------|------------|----------------|---------------|
| USD009 | 1183.60 | ▼3.6 | 4.9 | 741,110 |
| USD010 | 1183.30 | ▼3.8 | 4.8 | 11,442 |
| USD/KRW | 1183.00 | ▼4.8 | 4.7 | |
| USD/CNY | 6.8228 | ▼0.0029 | 0.0083 | |

◇ 전일 해외시장 동향

| 종목 | 전일종가 | 전일비(bp) | 종목 | 전일종가 |
|-----------|--------|---------|--------|--------|
| USD Index | 92.294 | ▲0.1500 | UST2Y | 0.1309 |
| EUR/USD | 1.1912 | ▼0.0024 | UST10Y | 0.6689 |
| USD/JPY | 105.96 | ▲0.0500 | UST30Y | 1.4200 |
| GBP/USD | 1.3384 | ▲0.0014 | WTI | 42.76 |

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

| 전 일(09/01) | |
|------------|---------------------------------------|
| 16:55 | 독일 8월 마켓 제조업 PMI(F)(결과:52.2, 잠정:53.0) |
| 18:00 | 유럽 8월 CPI YoY(결과:-0.2%, 이전:0.4%) |
| 22:45 | 미국 8월 마켓 제조업 PMI(F)(결과:53.1, 잠정:53.6) |
| 23:00 | 미국 8월 ISM 제조업지수(결과:56.0, 이전:54.2) |

| 금 일(09/02) | |
|------------|---|
| 21:15 | 미국 8월 ADP 취업자 변동(예상:950k, 이전:167k) |
| 23:00 | 미국 Fed 존 월리엄스(뉴욕, 투표권O) 연설 |
| 23:30 | 미국 DOE 주간 원유재고(예상:--, 이전:-4689k) (09/03) |
| 02:00 | 독일 앤스 바이트만 분데스뱅크 총재 연설 |
| 03:00 | 미국 Fed 베이지북 공개 |
| 04:00 | 미국 Fed 날 카시카리(미니애파리스, 투표권O) 연설 |

| 의 일(09/03) | |
|------------|---------------------------------------|
| 07:00 | 미국 Fed 메리 데일리(샌프란시스코, 투표권O) 연설 |
| 10:45 | 중국 8월 차이신 종합 PMI(예상:--, 이전:54.5) |
| 16:50 | 프랑스 8월 마켓 종합 PMI(F)(예상:51.7, 잠정:51.7) |
| 16:55 | 독일 8월 마켓 종합 PMI(F)(예상:53.7, 잠정:53.7) |
| 21:30 | 미국 주간 신규실업수당 청구(예상:950k, 이전:1006k) |
| 22:45 | 미국 8월 마켓 종합 PMI(F)(예상:--, 잠정:54.7) |
| 23:00 | 미국 8월 ISM 비제조업지수(예상:57.0, 이전:58.1) |

*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 | 1,183.60 | -3.60 | 1,187.20 | 1,187.40 | 1,182.50 | 4.90 | 264,695 | 3,363 | 741,110 | -14,222 |
| USD010 | 1,183.30 | -3.80 | 1,187.30 | 1,187.30 | 1,182.50 | 4.80 | 6,183 | -261 | 11,442 | 4,537 |
| USD SPOT | 1,183.00 | -4.80 | 1,186.10 | 1,187.20 | 1,182.50 | 4.70 | 6,681 | 101 | - | - |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

| 구분 | 매수 | 매도 | 순매수 | 5일누적 | 20일누적 |
|------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 금융투자 | 80,456 | 81,733 | -1,277 | -35,652 | -60,691 |
| 은행 | 672 | 491 | 181 | 1,402 | 18,659 |
| 투신 | 1,796 | 1,016 | 780 | 1,056 | 17,507 |
| 보험 | 95 | 443 | -348 | -1,902 | -9,758 |
| 기타법인 | 9,406 | 6,153 | 3,253 | 2,248 | 9,138 |
| 개인 | 29,805 | 19,331 | 10,474 | 4,308 | 24,286 |
| 외국인 | 158,653 | 171,716 | -13,063 | 31,580 | 889 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

| 종목 | 주가/금리 | 전일비 |
|--------|----------|--------|
| KOSPI | 2,349.55 | 23.38 |
| 국고채3Y | 0.977 | 0.037 |
| 국고채10Y | 1.582 | 0.066 |
| 신용지표 | | |
| 만기 | Mid | 전일비 |
| CDS 5Y | 21.948 | -0.058 |

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

| 종목 | 순매수 | 5일 누적 | 20일누적 |
|--------|--------|---------|---------|
| KOSPI | -2,057 | -18,962 | -27,691 |
| KOSDAQ | -1,037 | -40 | -427 |
| 국고채 | 4,074 | 8,307 | 16,463 |
| 통안채 | 1,486 | 2,234 | 23,408 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

| Korea | 종가 | 전일비 | US Libor | 종가 | 전일비 |
|-------|-------|--------|----------|---------|----------|
| 기준 | 0.500 | 0.000 | 1M | 0.15563 | -0.00112 |
| Call | 0.480 | -0.170 | 3M | 0.25113 | 0.01025 |
| CD | 0.630 | 0.000 | 6M | 0.30325 | -0.00663 |
| 통안1년 | 0.712 | 0.021 | 12M | 0.43263 | -0.01262 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

| 종목 | 종가 | 전일비 | 전일비(%) | 1주(%) |
|------------|-----------|---------|--------|--------|
| 다우지수 | 28,645.66 | 215.61 | 0.76 | 1.41 |
| S&P | 3,526.65 | 26.34 | 0.75 | 2.41 |
| 나스닥 | 11,939.67 | 164.21 | 1.39 | 4.13 |
| FTSE 100 | 5,862.05 | -101.52 | -1.70 | -3.98 |
| DAX 30 | 12,974.25 | 28.87 | 0.22 | -0.67 |
| Nikkei 225 | 23,138.07 | -1.69 | -0.01 | -0.68 |
| Shanghai | 3,410.61 | 14.93 | 0.44 | 1.10 |
| 항셍 H | 10,013.32 | 21.84 | 0.22 | -2.71 |
| 미국채 2년 | 0.13 | 0.00 | 0.00 | -12.32 |
| 미국채 10년 | 0.67 | -0.04 | -5.09 | -2.14 |
| WTI | 43.00 | 0.39 | 0.92 | -0.81 |
| Gold | 1,975.06 | 3.16 | 0.16 | 3.06 |

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

| 만기 | Mid | 전일비 |
|-----|-------|-------|
| 1M | 0.00 | 0.05 |
| 3M | -0.30 | 0.05 |
| 6M | -0.80 | 0.10 |
| 12M | -2.10 | 0.40 |
| CRS | | |
| 만기 | Mid | 전일비 |
| 1Y | 0.140 | 0.030 |
| 2Y | 0.055 | 0.030 |
| 3Y | 0.070 | 0.045 |
| 4Y | 0.070 | 0.045 |
| 5Y | 0.100 | 0.045 |

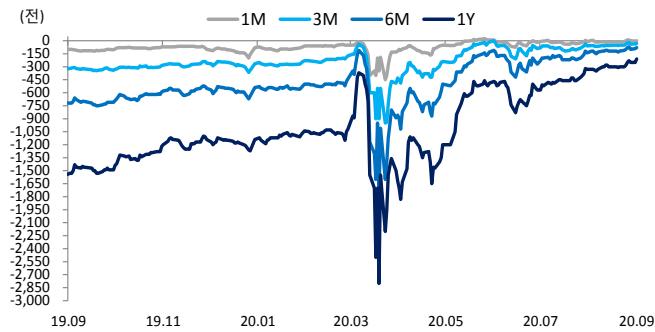
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

| 아시아 통화 | | | | | 기타 통화 | | | | | | |
|-----------|--------|---------|-------|---------|----------|---------|-------|---------|---------|---------|-------|
| 종목 | 종가 | 전일비 | 1주(%) | 종목 | 종가 | 전일비 | 1주(%) | 종목 | 종가 | 전일비 | 1주(%) |
| USD Index | 92.294 | 0.150 | -0.78 | USD/KRW | 1,183.15 | -4.70 | -0.16 | USD/RUB | 73.5867 | -0.4814 | -2.29 |
| EUR/USD | 1.1912 | -0.0024 | 0.65 | USD/CNY | 6.8281 | -0.0204 | -1.23 | USD/BRL | 5.3969 | -0.0976 | -2.03 |
| USD/JPY | 105.96 | 0.05 | -0.40 | USD/HKD | 7.7500 | -0.0002 | -0.01 | USD/ZAR | 16.6524 | -0.2892 | -1.21 |
| GBP/USD | 1.3384 | 0.0014 | 1.76 | USD/SGD | 1.3614 | 0.0011 | -0.48 | USD/MXN | 21.7827 | -0.1040 | -0.60 |
| USD/CHF | 0.9094 | 0.0057 | 0.19 | USD/TWD | 29.431 | 0.006 | 0.01 | USD/PLN | 3.6837 | -0.0006 | -0.95 |
| AUD/USD | 0.7372 | -0.0004 | 2.46 | USD/INR | 72.87 | -0.75 | -1.96 | USD/TRY | 7.3688 | 0.0245 | -0.29 |
| NZD/USD | 0.6759 | 0.0026 | 3.24 | USD/IDR | 14,573 | 10 | -0.52 | USD/SEK | 8.6848 | 0.0394 | -0.80 |
| USD/CAD | 1.3064 | 0.0017 | -0.83 | USD/THB | 31.077 | -0.041 | -1.28 | USD/NOK | 8.7607 | 0.0367 | -2.19 |

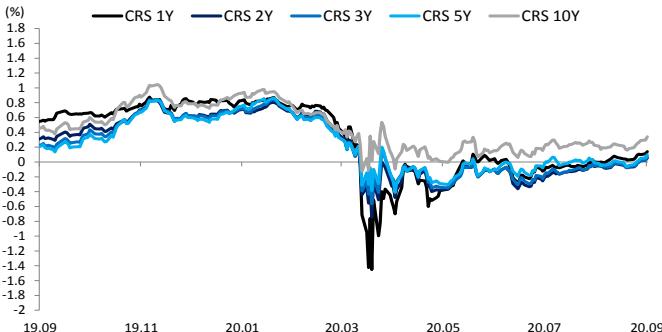
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



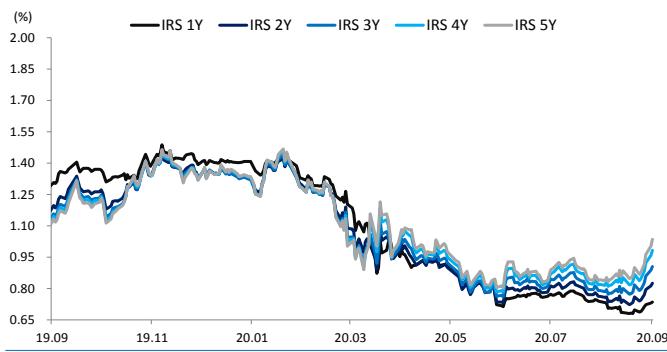
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



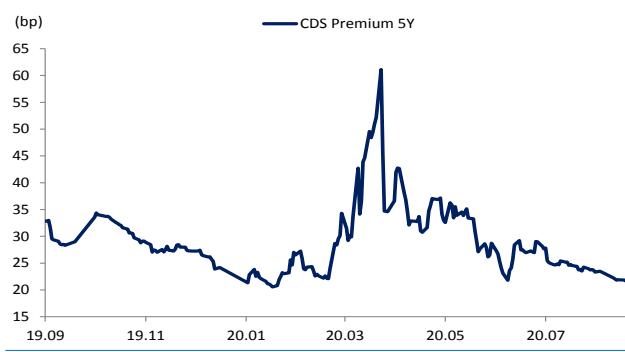
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



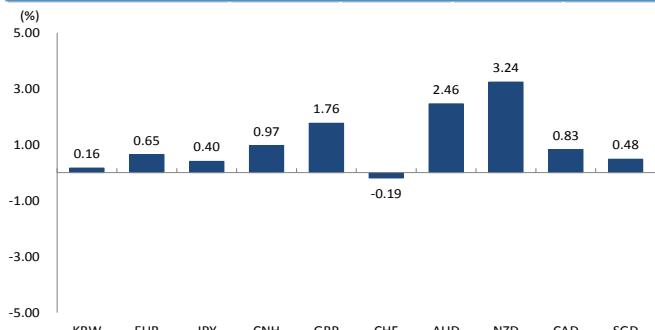
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



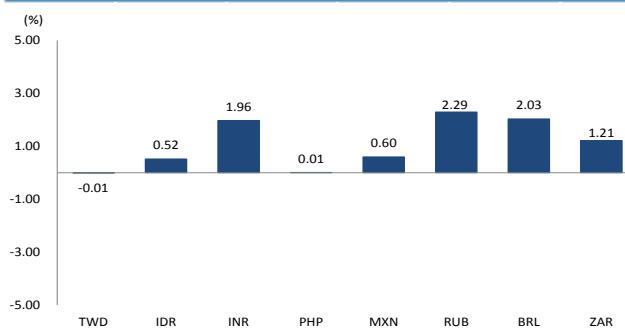
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터