

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD009	1185.90	▲2.3	3.1	749,148
USD010	1185.60	▲2.3	3.0	11,871
USD/KRW	1185.40	▲2.4	2.8	
USD/CNY	6.8291	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	92.644	▲0.3060	UST2Y	0.1329
EUR/USD	1.1855	▼0.0057	UST10Y	0.6477
USD/JPY	106.18	▲0.2200	UST30Y	1.3788
GBP/USD	1.3350	▼0.0034	WTI	41.51

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/02)

- 21:15 미국 8월 ADP 취업자 변동(결과:428k, 이전:212k)
 23:00 미국 Fed 존 월리엄스(뉴욕, 투표권) 연설
 23:30 미국 DOE 주간 원유재고(결과:-9362k, 이전:-4689k)
 (09/03)
 02:00 독일 온스 바이트만 분데스뱅크 총재 연설
 03:00 미국 Fed 베이저리브 공개
 04:00 미국 Fed 날 카시카리(미니애폴리스, 투표권) 연설

금 일(09/03)

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

의 일(09/04)

- 10:30 호주 7월 소매판매 MoM(예상:3.3%, 이전:2.7%)
 15:00 독일 7월 제조업수주 MoM(예상:5.0%, 이전:27.9%)
 17:30 영국 8월 마킷 건설 PMI(예상:58.3, 이전:58.1)
 21:30 미국 8월 비농업부문 고용자수 변동(예상:1390k, 이전:1763k)
 21:30 미국 8월 실업률(예상:9.8%, 이전:10.2%)

*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	1,185.90	2.30	1,184.70	1,187.60	1,184.50	3.10	201,335	-63,360	749,148	8,038
USD010	1,185.60	2.30	1,184.60	1,187.30	1,184.30	3.00	2,579	-3,604	11,871	429
USD SPOT	1,185.40	2.40	1,185.00	1,187.40	1,184.60	2.80	6,216	-465	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	45,158	58,194	-13,036	-46,330	-57,482
은행	400	300	100	1,262	19,261
투신	224	1,083	-859	-364	17,157
보험	409	797	-388	-4,297	-9,948
기타법인	5,509	7,598	-2,089	692	7,555
개인	16,640	22,990	-6,350	1,381	21,070
외국인	136,080	113,458	22,622	47,696	2,417

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,364.37	14.82
국고채3Y	0.923	-0.054
국고채10Y	1.539	-0.043
신용지표		
만기	Mid	전일비
CDS 5Y	21.554	-0.099

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-2,560	-23,432	-29,669
KOSDAQ	1,462	2,226	1,740
국고채	4,505	11,386	19,964
통안채	-1,307	927	23,514

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.15475	-0.00088
Call	0.540	0.060	3M	0.25125	0.00012
CD	0.630	0.000	6M	0.28775	-0.01550
통안1년	0.696	-0.016	12M	0.42500	-0.00763

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	29,100.50	454.84	1.59	2.71
S&P	3,580.84	54.19	1.54	2.94
나스닥	12,056.44	116.77	0.98	3.36
FTSE 100	5,940.95	78.90	1.35	-1.59
DAX 30	13,243.43	269.18	2.07	0.40
Nikkei 225	23,247.15	109.08	0.47	-0.19
Shanghai	3,404.80	-5.80	-0.17	2.25
항셍 H	10,000.96	-12.36	-0.12	-2.91
미국채 2년	0.13	0.00	1.53	-11.64
미국채 10년	0.65	-0.02	-3.17	-5.91
WTI	41.51	-1.25	-2.92	-4.33
Gold	1,936.28	-38.78	-1.96	-0.37

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.00	0.00
3M	-0.30	0.00
6M	-0.80	0.00
12M	-2.20	-0.10
CRS		
만기	Mid	전일비
1Y	0.115	-0.025
2Y	0.030	-0.025
3Y	0.050	-0.020
4Y	0.050	-0.020
5Y	0.085	-0.015

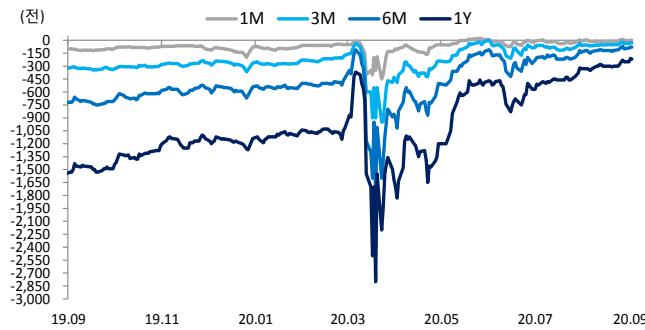
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화			기타 통화		
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가
USD Index	92,644	0.306	-0.39	USD/KRW	1,185.55
EUR/USD	1.1855	-0.0057	0.21	USD/CNY	6.8383
USD/JPY	106.18	0.22	0.18	USD/HKD	7.7502
GBP/USD	1.3350	-0.0034	1.06	USD/SGD	1.3625
USD/CHF	0.9107	0.0013	0.26	USD/TWD	29.433
AUD/USD	0.7338	-0.0034	1.45	USD/INR	73.03
NZD/USD	0.6772	0.0013	2.28	USD/IDR	14,745
USD/CAD	1.3045	-0.0019	-0.75	USD/THB	31.220
				USD/RUB	75.4066
				USD/BRL	5.3423
				USD/ZAR	16.8155
				USD/MXN	21.7689
				USD/PLN	3.7234
				USD/TRY	7.3872
				USD/SEK	8.7175
				USD/NOK	8.8387
					1.8199
					0.04
					-0.0546
					-4.80
					-0.35
					-0.0138
					-0.75
					-0.19
					0.26
					-0.01
					-0.57

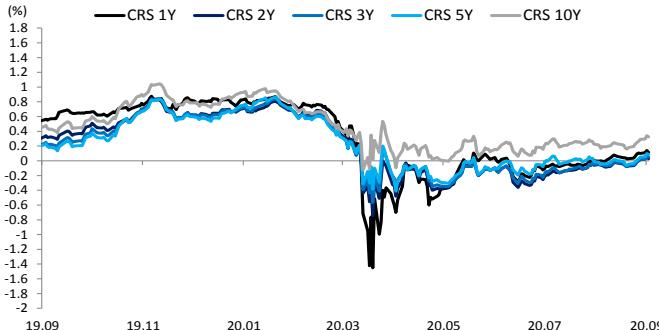
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



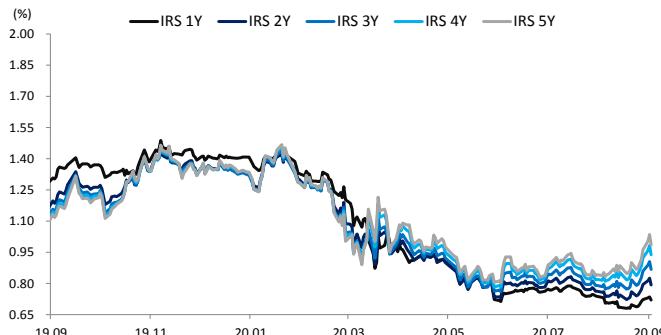
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



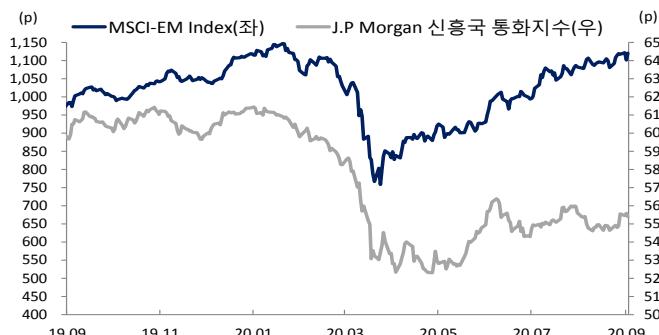
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



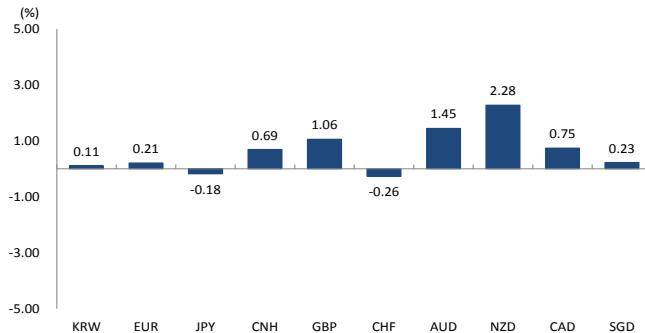
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



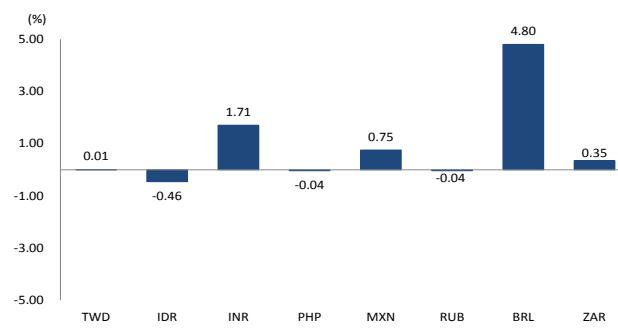
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터