

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD009	1190.40	▲2.2	3.6	744,923
USD010	1190.30	▲2.3	3.4	13,900
USD/KRW	1189.60	▲1.3	3.6	
USD/CNY	6.8418	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	92.719	▼0.0200	UST2Y	0.1428
EUR/USD	1.1838	▼0.0014	UST10Y	0.7180
USD/JPY	106.24	▲0.0500	UST30Y	1.4714
GBP/USD	1.3279	▼0.0002	WTI	39.77

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/04)

17:30 영국 8월 마켓 건설 PMI(결과:54.6, 이전:58.1)
 21:30 미국 8월 비농업부문 고용자수 변동(결과:1371k, 이전:1734k)
 21:30 미국 8월 실업률(결과:8.4%, 이전:10.2%)

금 일(09/07)

15:00 독일 7월 산업생산 MoM(예상:--, 이전:8.9%)
 17:30 유럽 9월 센티스 투자자기대지수(예상:--, 이전:-13.4%)
 N/A 중국 8월 수출 YoY(예상:6.0%, 이전:7.2%)
 N/A 중국 8월 수입 YoY(예상:1.0%, 이전:-1.4%)
 N/A 중국 8월 무역수지(예상:\$45.80b, 이전:\$62.33b)

의 일(09/08)

10:30 호주 8월 NAB 경기기대지수(예상:--, 이전:-14)
 15:00 독일 7월 경상수지(예상:--, 이전:22.4b)
 15:00 독일 7월 수출 MoM(예상:--, 이전:14.9%)
 15:00 독일 7월 수입 MoM(예상:--, 이전:7.0%)
 18:00 유럽 2분기 GDP QoQ(F)(예상:-15.0%, 잠정:-15.0%)
 19:00 미국 8월 NFIB 소기업 낙관지수(예상:98.9, 이전:98.8)

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD009	1,190.40	2.20	1,192.40	1,192.60	1,189.00	3.60	211,946	4,232	744,923	-5,074
USD010	1,190.30	2.30	1,192.10	1,192.30	1,188.90	3.40	7,677	344	13,900	2,158
USD SPOT	1,189.60	1.30	1,192.00	1,192.70	1,189.10	3.60	5,305	-455	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	67,943	44,388	23,555	-8,856	-20,983
은행	821	441	380	450	6,980
투신	1,467	448	1,019	658	4,316
보험	536	249	287	-2,506	-8,291
기타법인	7,180	10,635	-3,455	-5,798	-4,635
개인	23,058	22,041	1,017	-7,520	6,312
외국인	121,499	144,302	-22,803	23,572	16,331

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,368.25	-27.65
국고채3Y	0.929	0.010
국고채10Y	1.527	0.003

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	21.554	-0.099

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-4,678	-23,683	-33,530
KOSDAQ	-324	2,476	516
국고채	538	15,455	16,398
통안채	-603	173	19,508

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.15425	-0.00438
Call	0.540	0.060	3M	0.24800	-0.00150
CD	0.630	0.000	6M	0.29213	0.00488
통안1년	0.702	0.005	12M	0.42100	-0.00525

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	28,133.31	-159.42	-0.56	-1.82
S&P	3,426.96	-28.10	-0.81	-2.31
나스닥	11,313.13	-144.97	-1.27	-3.27
FTSE 100	5,799.08	-51.78	-0.88	-3.35
DAX 30	12,842.66	-215.11	-1.65	-1.46
Nikkei 225	23,205.43	-260.10	-1.11	1.41
Shanghai	3,355.37	-29.61	-0.87	-1.42
항셍 H	9,883.98	-56.15	-0.56	-2.93
미국채 2년	0.14	0.02	12.44	12.44
미국채 10년	0.72	0.08	13.12	-0.43
WTI	39.77	-1.60	-3.87	-7.45
Gold	1,927.90	-8.38	-0.43	0.37

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.00	0.00
3M	-0.25	0.00
6M	-0.80	0.00
12M	-2.20	-0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.080	-0.020
2Y	-0.010	-0.025
3Y	0.015	-0.020
4Y	0.030	-0.015
5Y	0.075	-0.010

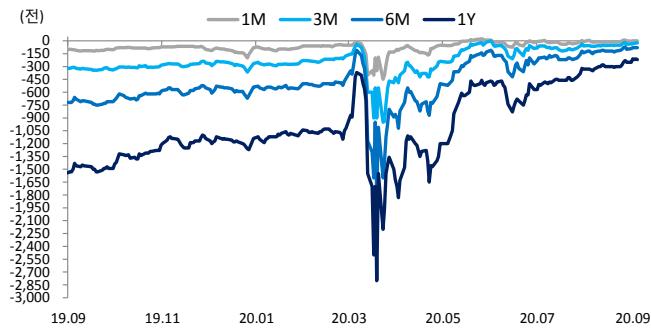
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	92.719	-0.020	0.38	USD/KRW	1,189.65	1.40	0.44	USD/RUB	75.4191	0.1575	1.89
EUR/USD	1.1838	-0.0014	-0.55	USD/CNY	6.8425	-0.0063	-0.33	USD/BRL	5.3016	0.0090	-1.62
USD/JPY	106.24	0.05	0.83	USD/HKD	7.7506	0.0003	0.00	USD/ZAR	16.6016	-0.1279	0.04
GBP/USD	1.3279	-0.0002	-0.55	USD/SGD	1.3647	0.0001	0.49	USD/MXN	21.5544	-0.0977	-0.95
USD/CHF	0.9135	0.0041	1.03	USD/TWD	29.428	0.001	-0.02	USD/PLN	3.7650	0.0210	2.18
AUD/USD	0.7282	0.0009	-1.13	USD/INR	73.14	-0.34	-0.36	USD/TRY	7.4383	0.0059	1.47
NZD/USD	0.6721	0.0009	-0.33	USD/IDR	14,750	-28	0.81	USD/SEK	8.7414	0.0048	1.35
USD/CAD	1.3062	-0.0066	-0.28	USD/THB	31.448	0.228	0.70	USD/NOK	8.9283	0.0104	0.97

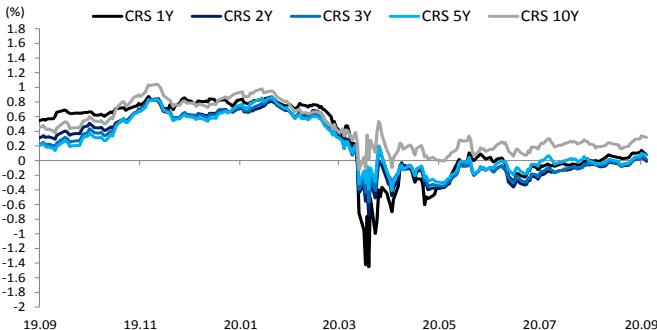
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



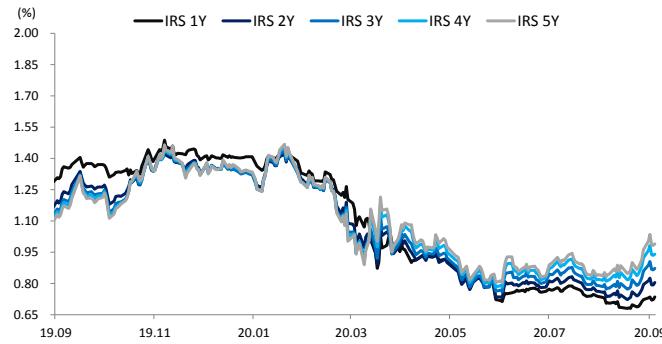
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



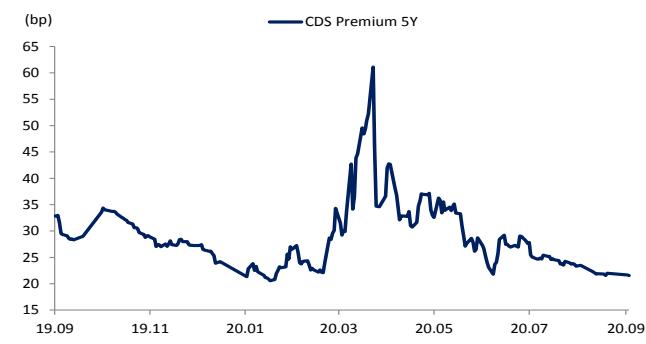
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



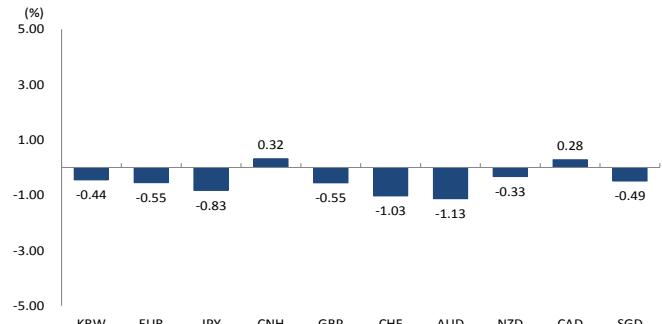
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



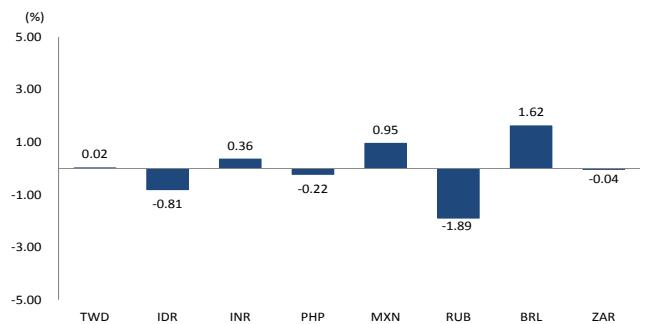
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터