

## FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

## 유로화 강세 지속에 약달러

금일 달러/원 예상 : 1,186.00~1,191.00

NDF 최종호가 : 1,187.60/1,188.00(+0.90)

야간달러선물 종가 : 1,187.90원 | 고가:1,188.00원 | 저가:1,186.20원

## ◇ 전일 국내시장 동향

| 종목      | 전일종가    | 전일비<br>(원) | 변동폭<br>(고가-저가) | 미결제약정<br>(계약) |
|---------|---------|------------|----------------|---------------|
| USD009  | 1187.00 | ▲1.5       | 2.8            | 706,051       |
| USD010  | 1187.40 | ▲2.5       | 2.6            | 26,956        |
| USD/KRW | 1186.90 | ▲2.0       | 2.8            |               |
| USD/CNY | 6.8371  | ▼0.0029    | 0.0083         |               |

## ◇ 전일 해외시장 동향

| 종목        | 전일종가   | 전일비(bp) | 종목     | 전일종가   |
|-----------|--------|---------|--------|--------|
| USD Index | 93.333 | ▼0.0030 | UST2Y  | 0.1270 |
| EUR/USD   | 1.1846 | ▲0.0031 | UST10Y | 0.6658 |
| USD/JPY   | 106.16 | ▲0.0300 | UST30Y | 1.4116 |
| GBP/USD   | 1.2796 | ▼0.0009 | WTI    | 37.33  |

## 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(09/11)

21:30 미국 8월 CPI YoY(결과:1.3%, 이전:1.0%)

## 금 일(09/14)

13:30 일본 7월 3차 산업 지수 MoM(예상:0.5%, 이전:7.9%)

## 의 일(09/15)

11:00 중국 8월 산업생산 YoY(예상:5.1%, 이전:4.8%)

13:30 일본 7월 산업생산 MoM(F)(예상:--, 잠정:8.0%)

11:00 중국 8월 소매판매 YoY(예상:0.0%, 이전:-1.1%)

18:00 영국 7월 산업생산 MoM(예상:4.2%, 이전:9.1%)

15:45 프랑스 8월 CPI YoY(F)(예상:0.2%, 잠정:0.2%)

18:00 독일 9월 ZEW 서비스(예상:--, 이전:71.5)

18:00 유럽 9월 ZEW 서비스(예상:--, 이전:64.0)

21:30 미국 9월 엠파이어스테이트 제조업지수(예상:4.4, 이전:3.7)

22:15 미국 8월 산업생산 MoM(예상:71.7%, 이전:70.6%)

## USD Futures &amp; Spot

| 종목       | 종가       | 전일비  | 시가       | 고가       | 저가       | 변동폭  | 거래량     | 전일대비   | 미결제약정   | 전일대비   |
|----------|----------|------|----------|----------|----------|------|---------|--------|---------|--------|
| USD009   | 1,187.00 | 1.50 | 1,188.00 | 1,189.40 | 1,186.60 | 2.80 | 194,280 | -1,764 | 706,051 | -5,991 |
| USD010   | 1,187.40 | 2.50 | 1,187.40 | 1,189.10 | 1,186.50 | 2.60 | 8,323   | 496    | 26,956  | 702    |
| USD SPOT | 1,186.90 | 2.00 | 1,188.00 | 1,189.30 | 1,186.50 | 2.80 | 4,404   | -1,312 | -       | -      |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

| 구분   | 매수      | 매도      | 순매수    | 5일누적    | 20일누적   |
|------|---------|---------|--------|---------|---------|
| 금융투자 | 65,320  | 57,482  | 7,838  | 28,737  | 15,214  |
| 은행   | 689     | 1,291   | -602   | 6,320   | 14,105  |
| 투신   | 1,691   | 1,020   | 671    | 7,372   | 27,084  |
| 보험   | 46      | 351     | -305   | 1,565   | -5,665  |
| 기타법인 | 4,778   | 7,385   | -2,607 | 1,795   | -5,053  |
| 개인   | 17,467  | 23,789  | -6,322 | 6,775   | 8,005   |
| 외국인  | 120,038 | 118,711 | 1,327  | -52,564 | -53,660 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

| 종목     | 주가/금리    | 전일비   |
|--------|----------|-------|
| KOSPI  | 2,396.69 | 0.21  |
| 국고채3Y  | 0.926    | 0.011 |
| 국고채10Y | 1.530    | 0.013 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

| 만기     | Mid    | 전일비    |
|--------|--------|--------|
| CDS 5Y | 22.613 | -0.020 |

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

| 종목     | 순매수    | 5일 누적  | 20일누적   |
|--------|--------|--------|---------|
| KOSPI  | -1,498 | -1,603 | -29,627 |
| KOSDAQ | -1,919 | -3,111 | -2,342  |
| 국고채    | 10,839 | 33,728 | 46,501  |
| 통안채    | 1,397  | 5,420  | 19,703  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

| Korea | 종가    | 전일비    | US Libor | 종가      | 전일비      |
|-------|-------|--------|----------|---------|----------|
| 기준    | 0.500 | 0.000  | 1M       | 0.15238 | 0.00125  |
| Call  | 0.460 | -0.040 | 3M       | 0.25038 | 0.00125  |
| CD    | 0.630 | 0.000  | 6M       | 0.28188 | -0.00300 |
| 통안1년  | 0.692 | 0.008  | 12M      | 0.41388 | -0.00025 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

| 종목         | 종가        | 전일비    | 전일비(%) | 1주(%)  |
|------------|-----------|--------|--------|--------|
| 다우지수       | 27,665.64 | 131.06 | 0.48   | -2.22  |
| S&P        | 3,340.97  | 1.78   | 0.05   | -3.30  |
| 나스닥        | 10,853.54 | -66.05 | -0.60  | -5.28  |
| FTSE 100   | 6,032.09  | 28.77  | 0.48   | 4.02   |
| DAX 30     | 13,202.84 | -6.05  | -0.05  | 2.80   |
| Nikkei 225 | 23,406.49 | 171.02 | 0.74   | 0.87   |
| Shanghai   | 3,260.35  | 25.52  | 0.79   | -2.83  |
| 항셍 H       | 9,752.50  | 68.75  | 0.71   | -1.33  |
| 미국채 2년     | 0.13      | -0.01  | -8.57  | -11.06 |
| 미국채 10년    | 0.67      | -0.01  | -1.68  | -7.27  |
| WTI        | 37.33     | 0.03   | 0.08   | -9.77  |
| Gold       | 1,954.08  | 5.69   | 0.29   | 1.36   |

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

| 만기  | Mid   | 전일비  |
|-----|-------|------|
| 1M  | 0.00  | 0.00 |
| 3M  | -0.25 | 0.05 |
| 6M  | -0.70 | 0.10 |
| 12M | -1.90 | 0.10 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

| 만기 | Mid   | 전일비   |
|----|-------|-------|
| 1Y | 0.105 | 0.000 |
| 2Y | 0.020 | 0.000 |
| 3Y | 0.060 | 0.000 |
| 4Y | 0.105 | 0.010 |
| 5Y | 0.170 | 0.010 |

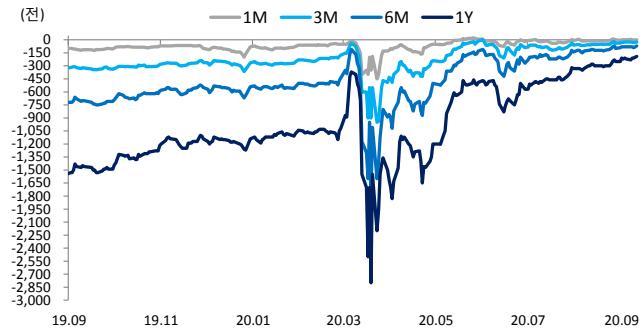
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

| 아시아 통화    |        |         |       |         | 기타 통화    |         |       |         |         |         |       |
|-----------|--------|---------|-------|---------|----------|---------|-------|---------|---------|---------|-------|
| 종목        | 종가     | 전일비     | 1주(%) | 종목      | 종가       | 전일비     | 1주(%) | 종목      | 종가      | 전일비     | 1주(%) |
| USD Index | 93.333 | -0.003  | 0.66  | USD/KRW | 1,186.90 | 2.00    | -0.23 | USD/RUB | 75.0403 | -0.1800 | -0.50 |
| EUR/USD   | 1.1846 | 0.0031  | 0.07  | USD/CNY | 6.8344   | 0.0001  | -0.12 | USD/BRL | 5.3196  | -0.0007 | 0.34  |
| USD/JPY   | 106.16 | 0.03    | -0.08 | USD/HKD | 7.7503   | -0.0001 | 0.00  | USD/ZAR | 16.7357 | -0.1721 | 0.81  |
| GBP/USD   | 1.2796 | -0.0009 | -3.64 | USD/SGD | 1.3678   | -0.0021 | 0.23  | USD/MXN | 21.2760 | -0.1674 | -1.29 |
| USD/CHF   | 0.9089 | -0.0017 | -0.50 | USD/TWD | 29.384   | -0.118  | -0.15 | USD/PLN | 3.7555  | -0.0141 | -0.25 |
| AUD/USD   | 0.7284 | 0.0026  | 0.03  | USD/INR | 73.54    | 0.08    | 0.55  | USD/TRY | 7.4761  | 0.0267  | 0.51  |
| NZD/USD   | 0.6666 | 0.0015  | -0.82 | USD/IDR | 14,890   | 35      | 0.95  | USD/SEK | 8.7761  | 0.0001  | 0.40  |
| USD/CAD   | 1.3179 | -0.0013 | 0.90  | USD/THB | 31.325   | 0.020   | -0.39 | USD/NOK | 9.0371  | -0.0390 | 1.22  |

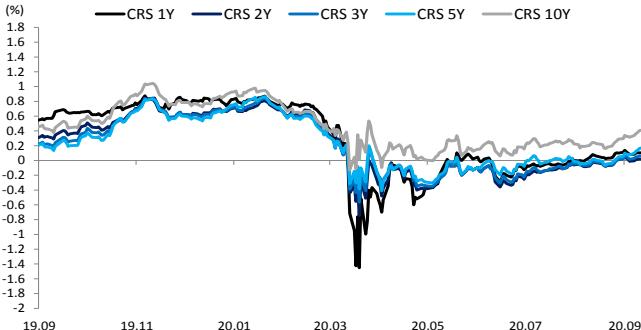
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



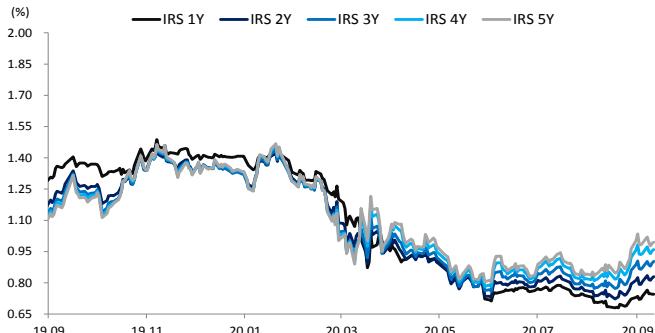
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



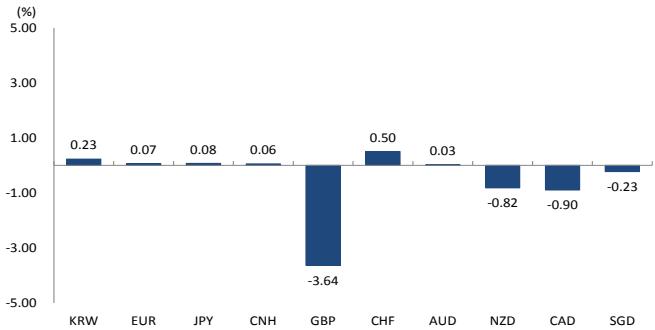
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



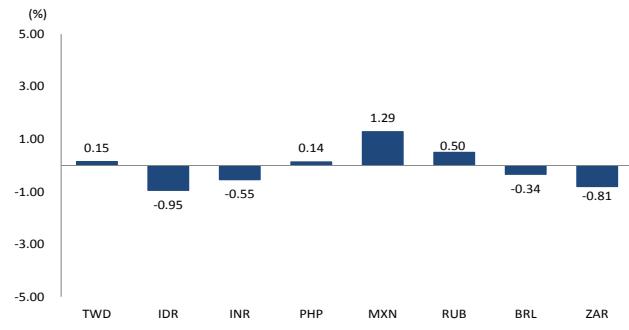
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터