

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

8개월만의 1,160원대

금일 달러/원 예상 : 1,162.00~1,169.00

NDF 최종호가 : 1,164.80/1,165.20(+4.65)

야간달러선물 종가 : 1,164.40원 | 고가:1,164.40원 | 저가:1,155.50원

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD009	1161.70	▼11.9	10.3	161,959
USD010	1160.00	▼13.5	10.5	794,937
USD/KRW	1160.30	▼14.1	10.4	
USD/CNY	6.7569	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	92.926	▼0.0440	UST2Y	0.1391
EUR/USD	1.1840	▼0.0008	UST10Y	0.6937
USD/JPY	104.57	▼0.1700	UST30Y	1.4532
GBP/USD	1.2917	▼0.0056	WTI	41.11

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/18)

- 21:30 미국 2분기 경상수지(결과:-\$170.5b, 이전:-\$111.5b)
- 23:00 미국 8월 선행지수 MoM(결과:1.2%, 이전:2.0%)
- 23:00 미국 9월 미시간대학교 소비자신뢰(P)(결과:78.9, 이전:74.1)

금 일(09/21)

- 09:00 한국 9월 수출 20일 YoY(예상:--, 이전:-7.0%)
- 10:30 중국 인민은행 대출우대금리 결정(예상: 동결)
- 21:30 미국 8월 시카고 연은 국가활동지수(예상:1.18, 이전:1.18)
(09/22)
- 01:00 미국 Fed 라엘 브레이너드 의사 연설

의 일(09/22)

- 23:00 유럽 9월 소비자기대지수(예상:-15.0, 이전:-14.7)
- 23:00 미국 8월 기준주택매매(예상:6.00m, 이전:5.86m)
- 23:00 미국 9월 리치몬드 연은 제조업지수(예상:12, 이전:18)
- 23:30 미국 Fed 제롬 파월 의장 증언

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD009	1,161.70	-11.90	1,170.40	1,170.40	1,160.10	10.30	311,447	-45,043	161,959	-157,053
USD010	1,160.00	-13.50	1,170.40	1,170.40	1,159.90	10.50	258,837	174,729	794,937	251,938
USD SPOT	1,160.30	-14.10	1,169.50	1,170.50	1,160.10	10.40	10,316	3,994	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	301,047	290,139	10,908	18,716	39,949
은행	94,086	93,762	324	-13,321	-5,658
투신	36,233	45,152	-8,919	-11,726	-3,638
보험	52,402	52,083	319	1,285	-2,373
기타법인	51,243	39,576	11,667	30,670	31,832
개인	79,017	56,399	22,618	41,788	54,820
외국인	343,599	380,476	-36,877	-67,472	-114,952

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,412.40	6.23
국고채3Y	0.907	-0.007
국고채10Y	1.503	-0.005

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	22.538	-0.056

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	1,473	5,981	-16,337
KOSDAQ	1,350	540	451
국고채	170	6,145	49,303
통안채	0	9,896	19,092

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.15575	-0.00050
Call	0.480	0.150	3M	0.22538	-0.00200
CD	0.630	0.000	6M	0.27525	-0.00038
통안1년	0.686	-0.002	12M	0.37388	-0.00237

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,657.42	-244.56	-0.88	-0.03
S&P	3,319.47	-37.54	-1.12	-0.64
나스닥	10,793.28	-117.00	-1.07	-0.56
FTSE 100	6,007.05	-42.87	-0.71	-0.42
DAX 30	13,116.25	-91.87	-0.70	-0.66
Nikkei 225	23,360.30	40.93	0.18	-0.20
Shanghai	3,338.09	67.66	2.07	2.38
항셍 H	9,803.10	70.95	0.73	0.52
미국채 2년	0.14	0.00	3.04	9.53
미국채 10년	0.69	0.01	0.73	4.19
WTI	41.11	0.14	0.34	10.13
Gold	1,944.89	-20.54	-1.05	-0.47

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.05	0.00
3M	-0.10	0.00
6M	-0.50	0.10
12M	-1.40	0.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.150	0.010
2Y	0.060	0.010
3Y	0.090	0.005
4Y	0.140	0.005
5Y	0.220	0.000

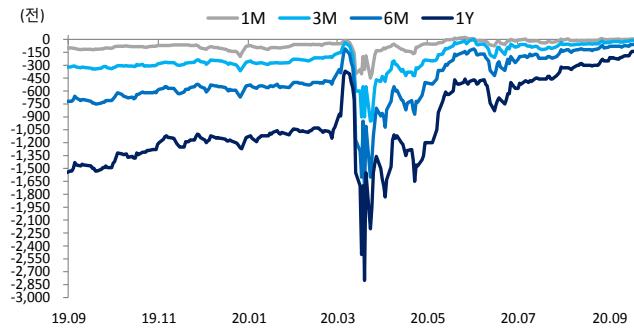
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	92.926	-0.044	-0.44	USD/KRW	1,160.45	-13.95	-2.23	USD/RUB	75.7303	0.5483	0.92
EUR/USD	1.1840	-0.0008	-0.05	USD/CNY	6.7691	0.0053	-0.96	USD/BRL	5.3885	0.1490	1.30
USD/JPY	104.57	-0.17	-1.50	USD/HKD	7.7501	0.0000	0.00	USD/ZAR	16.3274	0.1686	-2.44
GBP/USD	1.2917	-0.0056	0.95	USD/SGD	1.3599	0.0029	-0.58	USD/MXN	21.1323	0.2634	-0.68
USD/CHF	0.9116	0.0033	0.30	USD/TWD	29.085	-0.137	-1.02	USD/PLN	3.7674	0.0083	0.32
AUD/USD	0.7289	-0.0024	0.07	USD/INR	73.45	-0.20	-0.12	USD/TRY	7.5625	0.0116	1.16
NZD/USD	0.6759	0.0004	1.40	USD/IDR	14,735	-98	-1.04	USD/SEK	8.7658	-0.0076	-0.12
USD/CAD	1.3204	0.0037	0.19	USD/THB	31.103	-0.097	-0.71	USD/NOK	9.0942	0.0461	0.63

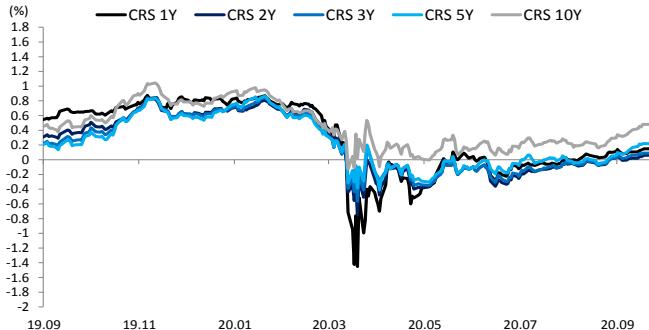
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



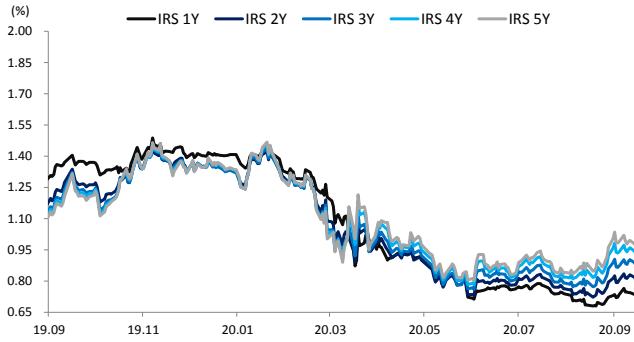
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



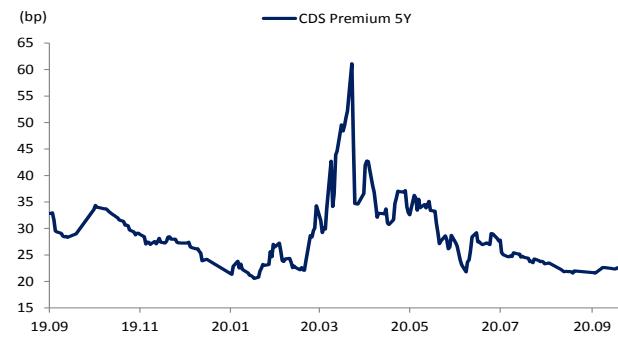
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



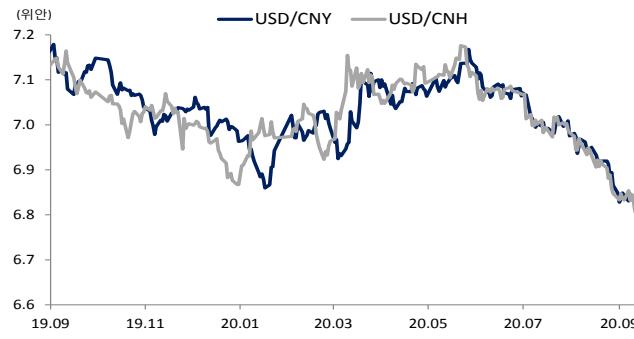
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



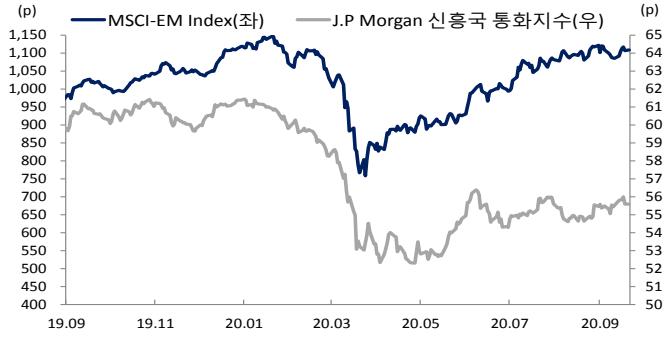
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



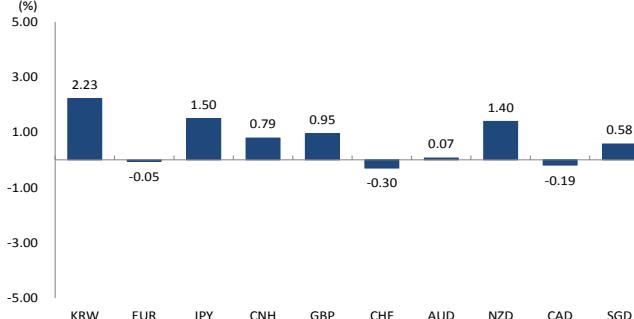
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



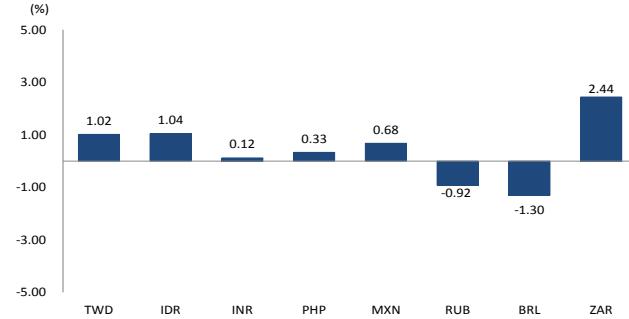
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터