

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

코로나 재확산, 美 정치불안의 더블 악재

금일 달러/원 예상 : 1,171.00~1,178.00

NDF 최종호가 : 1,174.30/1,174.80(+2.15)

야간달러선물 종가 : 1,174.80원 | 고가:1,177.20원 | 저가:1,172.30원

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD010	1172.40	▼1.1	5.1	785,212
USD011	1172.90	▼0.1	4.9	3,686
USD/KRW	1172.30	▼0.4	5.1	
USD/CNY	6.8201	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	94.642	▲0.2880	UST2Y	0.1289
EUR/USD	1.1631	▼0.0041	UST10Y	0.6544
USD/JPY	105.58	▲0.1700	UST30Y	1.4007
GBP/USD	1.2746	▼0.0001	WTI	40.25

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/25)

- 17:00 유로존 8월 M3 통화공급 YoY(결과:9.5%, 이전:10.1%)
21:30 미국 8월 내구재 주문(P)(결과:0.4%, 이전:11.7%)
22:00 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권) 총재 연설

금 일(09/28)

- 14:00 일본 7월 선행지수(F)(예상:--, 잠정:86.9)
23:30 미국 9월 달러스 연은 제조업지수(예상:8.5, 이전:8.0)
(09/29)
03:00 미국 Fed 로레타 메스터(클리브랜드, 투표권) 총재 연설

익 일(09/29)

- 21:25 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권) 총재 연설
22:30 미국 Fed 패트릭 하커(필라델피아, 투표권) 총재 연설
21:30 미국 8월 도매재고 MoM(P)(예상:--, 이전:-0.3%)
23:00 미국 9월 CB 소비자기대지수(예상:90.0, 이전:84.8)
(09/30)
00:40 미국 Fed 리처드 클라리다 부의장 연설
02:00 미국 Fed 랜들 월스 부의장 연설

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD010	1,172.40	-1.10	1,169.40	1,173.70	1,168.60	5.10	332,719	-39,131	785,212	-28,093
USD011	1,172.90	-0.10	1,169.60	1,173.50	1,168.60	4.90	2,688	543	3,686	651
USD SPOT	1,172.30	-0.40	1,169.50	1,173.80	1,168.70	5.10	8,191	-931	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	85,678	104,347	-18,669	49,157	87,754
은행	1,101	3,460	-2,359	25,790	19,239
투신	707	376	331	-7,821	-11,517
보험	542	76	466	1,983	2,327
기타법인	5,538	7,568	-2,030	-8,869	17,798
개인	25,597	27,759	-2,162	-34,442	6,601
외국인	216,289	191,866	24,423	-25,798	-122,262

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,278.79	6.09
국고채3Y	0.855	-0.002
국고채10Y	1.424	-0.013

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	28.092	-0.013

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-898	-4,323	-23,628
KOSDAQ	649	-767	-862
국고채	-446	5,356	60,684
통안채	-1,499	1,237	16,726

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14613	0.00138
Call	0.480	0.000	3M	0.21788	-0.01537
CD	0.630	0.000	6M	0.27125	-0.00225
통안1년	0.674	0.001	12M	0.36925	-0.00288

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,173.96	358.52	1.34	-1.75
S&P	3,298.46	51.87	1.60	-0.63
나스닥	10,913.56	241.29	2.26	1.11
FTSE 100	5,842.67	19.89	0.34	-2.74
DAX 30	12,469.20	-137.37	-1.09	-4.93
Nikkei 225	23,204.62	116.80	0.51	-1.15
Shanghai	3,219.42	-3.76	-0.12	-3.56
항셍 H	9,302.59	-68.60	-0.73	-5.11
미국채 2년	0.13	0.00	-2.94	-7.33
미국채 10년	0.65	-0.01	-1.73	-5.67
WTI	40.25	-0.06	-0.15	-2.09
Gold	1,870.66	4.21	0.23	-3.82

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.05	0.00
3M	0.05	0.10
6M	-0.50	0.10
12M	-1.60	0.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.100	-0.005
2Y	-0.030	-0.020
3Y	-0.020	-0.020
4Y	0.005	-0.040
5Y	0.070	-0.050

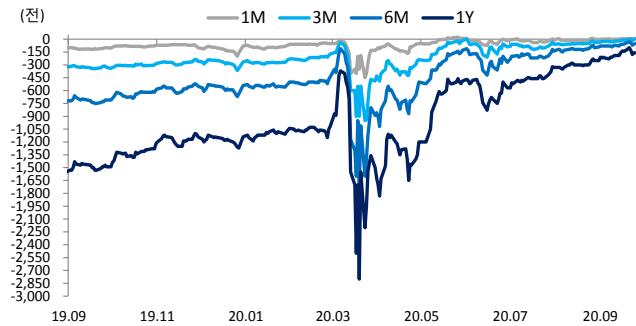
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	94.642	0.288	1.85	USD/KRW	1,172.50	-0.25	1.04	USD/RUB	78.1899	1.0565	3.25
EUR/USD	1.1631	-0.0041	-1.77	USD/CNY	6.8238	-0.0049	0.81	USD/BRL	5.5626	0.0524	3.23
USD/JPY	105.58	0.17	0.97	USD/HKD	7.7500	-0.0002	0.00	USD/ZAR	17.1313	0.2017	4.92
GBP/USD	1.2746	-0.0001	-1.32	USD/SGD	1.3776	0.0016	1.30	USD/MXN	22.3363	0.1835	5.70
USD/CHF	0.9283	0.0015	1.83	USD/TWD	29.208	-0.080	0.42	USD/PLN	3.9084	0.0054	3.74
AUD/USD	0.7031	-0.0016	-3.54	USD/INR	73.61	-0.29	0.22	USD/TRY	7.6639	0.0411	1.34
NZD/USD	0.6546	0.0000	-3.15	USD/IDR	14,873	-17	0.94	USD/SEK	9.1283	0.0287	4.14
USD/CAD	1.3386	0.0024	1.38	USD/THB	31.590	-0.042	1.57	USD/NOK	9.5737	0.0786	5.27

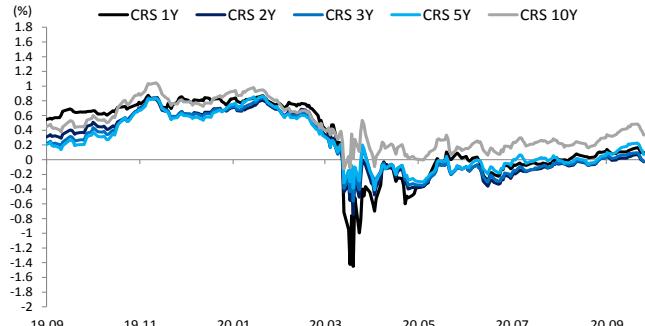
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



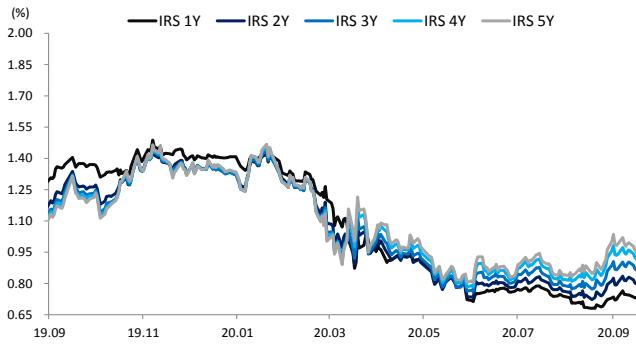
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



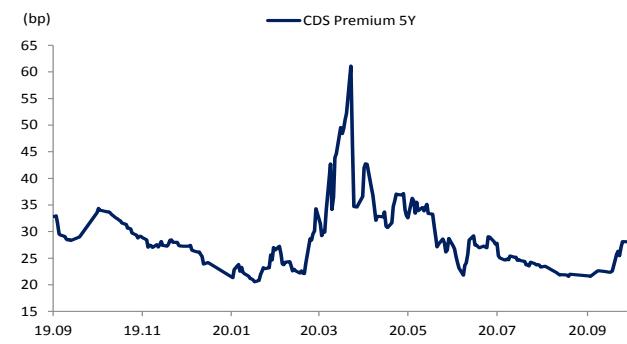
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



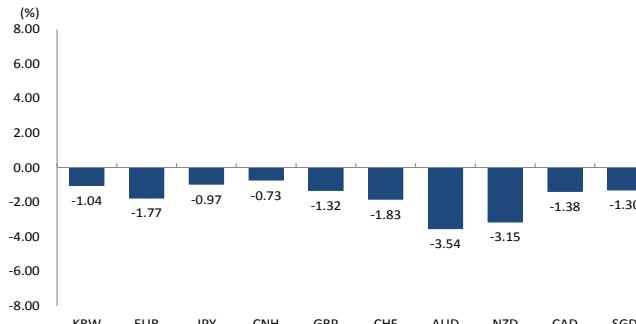
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



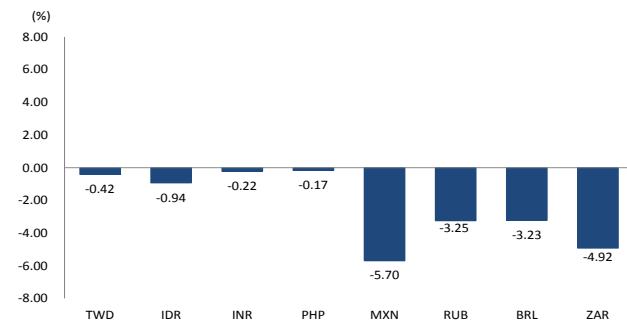
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터