

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD010	1172.80	▲0.4	2.7	786,045
USD011	1173.00	▲0.1	2.5	8,104
USD/KRW	1173.60	▲1.3	2.6	
USD/CNY	6.8201	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	94.273	▼0.3690	UST2Y	0.1250
EUR/USD	1.1666	▲0.0035	UST10Y	0.6528
USD/JPY	105.50	▼0.0800	UST30Y	1.4149
GBP/USD	1.2834	▲0.0088	WTI	40.57

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/28)

23:30 미국 9월 달러스 연은 제조업지수(결과:13.6, 이전:8.0)
(09/29)

03:00 미국 Fed 로레타 메스터(클리브랜드, 투표권) 총재 연설

금 일(09/29)

21:25 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권) 총재 연설
21:30 미국 8월 도매재고 MoM(P)(예상:--, 이전:-0.3%)
22:30 미국 Fed 패트릭 하커(필라델피아, 투표권) 총재 연설
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

의 일(10/05)

09:00 호주 9월 인플레이션 MoM(예상:--, 이전:1.3%)
16:55 독일 9월 마켓 종합 PMI(F)(예상:--, 잠정:53.7)
17:00 유로존 9월 마켓 종합 PMI(F)(예상:--, 잠정:50.1)
18:00 유로존 8월 소매판매 MoM(예상:--, 이전:-1.3%)
22:45 미국 9월 마켓 종합 PMI(F)(예상:--, 잠정:54.4)
23:00 미국 9월 ISM 서비스지수(예상:56.0, 이전:56.9)

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD010	1,172.80	0.40	1,173.80	1,174.90	1,172.20	2.70	247,810	-84,909	786,045	833
USD011	1,173.00	0.10	1,172.90	1,174.70	1,172.20	2.50	4,760	2,072	8,104	4,418
USD SPOT	1,173.60	1.30	1,173.30	1,174.80	1,172.20	2.60	5,752	-2,439	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	68,685	70,411	-1,726	11,672	105,259
은행	1,747	63	1,684	9,405	20,311
투신	4,411	5,078	-667	-4,750	-12,076
보험	187	36	151	2,141	4,286
기타법인	5,330	6,428	-1,098	-11,638	18,765
개인	19,095	26,078	-6,983	-34,997	12,146
외국인	157,703	148,964	8,739	28,267	-148,651

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,308.08	29.29
국고채3Y	0.843	-0.012
국고채10Y	1.426	0.002

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	27.168	-0.002

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-589	-4,129	-7,891
KOSDAQ	801	1,527	-2,506
국고채	-1,611	3,043	53,477
통안채	4,699	5,313	20,326

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14663	0.00050
Call	0.480	-0.050	3M	0.22038	0.00250
CD	0.630	0.000	6M	0.26925	-0.00200
통안1년	0.671	-0.003	12M	0.36550	-0.00375

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,584.06	410.10	1.51	1.61
S&P	3,351.60	53.14	1.61	2.15
나스닥	11,117.53	203.97	1.87	3.14
FTSE 100	5,927.93	85.26	1.46	2.13
DAX 30	12,870.87	401.67	3.22	2.62
Nikkei 225	23,511.62	307.00	1.32	0.82
Shanghai	3,217.54	-1.88	-0.06	-3.00
항셍 H	9,383.40	80.81	0.87	-2.67
미국채 2년	0.13	0.00	-3.03	-8.83
미국채 10년	0.65	0.00	-0.24	-1.95
WTI	40.57	0.32	0.80	3.21
Gold	1,874.63	13.05	0.70	-1.49

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

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

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.075	-0.025
2Y	-0.070	-0.040
3Y	-0.065	-0.045
4Y	-0.040	-0.045
5Y	0.020	-0.050

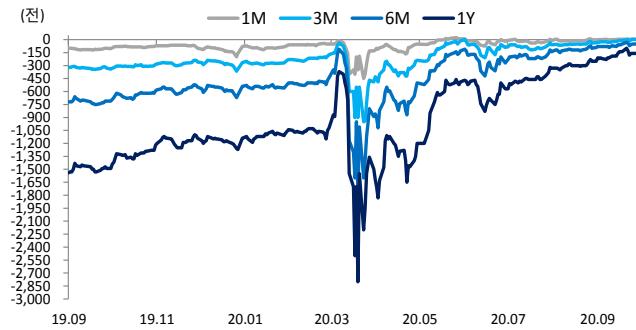
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	94.273	-0.369	0.66	USD/KRW	1,173.50	1.00	1.34	USD/RUB	79.0660	0.8761	3.86
EUR/USD	1.1666	0.0035	-0.89	USD/CNY	6.8113	-0.0125	0.09	USD/BRL	5.6624	0.0998	4.57
USD/JPY	105.50	-0.08	0.81	USD/HKD	7.7501	0.0001	0.00	USD/ZAR	17.0563	-0.0750	1.63
GBP/USD	1.2834	0.0088	0.13	USD/SGD	1.3730	-0.0046	0.79	USD/MXN	22.4183	0.0820	5.03
USD/CHF	0.9251	-0.0032	1.16	USD/TWD	29.151	-0.057	0.25	USD/PLN	3.9313	0.0229	2.96
AUD/USD	0.7071	0.0040	-2.12	USD/INR	73.79	0.17	0.52	USD/TRY	7.8062	0.1423	2.35
NZD/USD	0.6554	0.0008	-1.71	USD/IDR	14,900	27	1.36	USD/SEK	9.0427	-0.0856	2.21
USD/CAD	1.3370	-0.0016	0.47	USD/THB	31.733	0.143	1.61	USD/NOK	9.4805	-0.0932	2.19

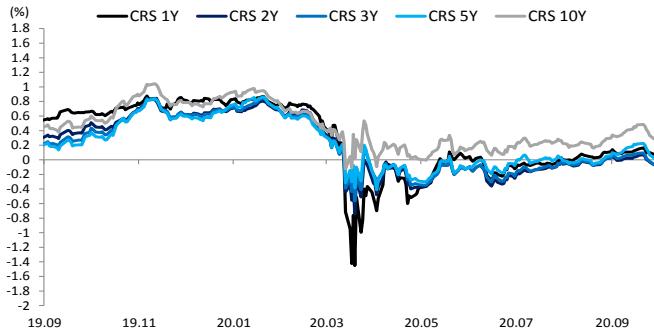
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



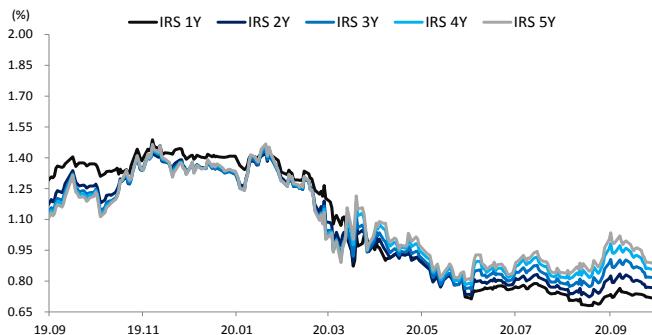
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



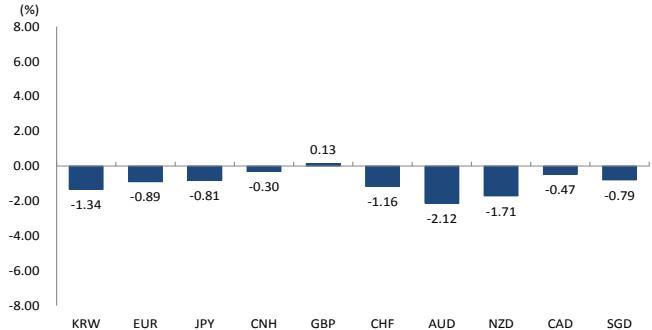
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



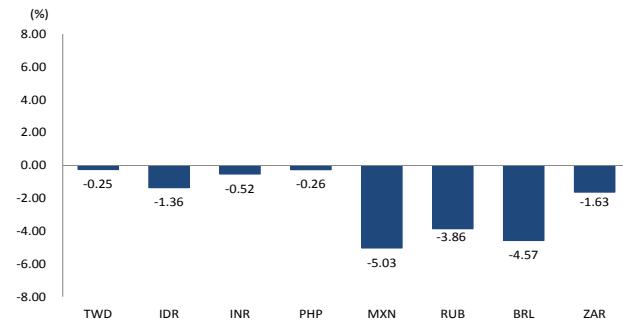
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터