

## FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

## 美 대선 전 초대형 변수, 트럼프 확진

금일 달러/원 예상 : 1,163.00~1,169.00

NDF 최종호가 : 1,166.30/1,166.70(-3.00)

야간달러선물 종가 : 1,168.70원 | 고가:1,170.00원 | 저가:1,167.20원

## ◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD010	1170.00	▼2.8	3.6	742,782
USD011	1169.30	▼3.7	3.2	6,827
USD/KRW	1169.50	▼4.1	3.7	
USD/CNY	6.7908	▼0.0029	0.0083	

## ◇ 전일 해외시장 동향

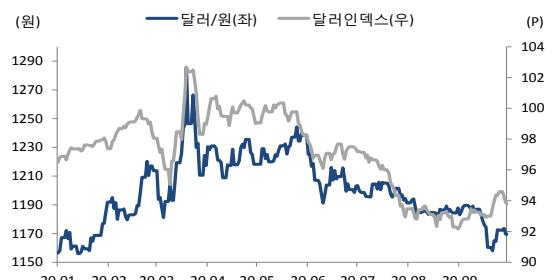
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.844	▲0.1330	UST2Y	0.1289
EUR/USD	1.1716	▼0.0032	UST10Y	0.7005
USD/JPY	105.29	▼0.2400	UST30Y	1.4868
GBP/USD	1.2935	▲0.0044	WTI	37.05

## 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(09/29)

- 21:25 미국 Fed 존 월리엄스(뉴욕, 투표권) 총재 연설  
21:30 미국 8월 도매재고 MoM(P)(결과:0.5%, 이전:-0.3%)  
22:30 미국 Fed 페트릭 하커(필라델피아, 투표권) 총재 연설  
23:00 미국 9월 CB 소비자기대지수(결과:101.8, 이전:84.8)  
(09/30)  
00:40 미국 Fed 리처드 클라리다 부의장 연설  
02:00 미국 Fed 랜들 웰스 부의장 연설

## 금 일(10/05)

- 09:00 호주 9월 인플레이션 MoM(예상:--, 이전:1.3%)  
16:55 독일 9월 마킷 종합 PMI(F)(예상:53.7, 잠정:53.7)  
17:00 유로존 9월 마킷 종합PMI(F)(예상:50.1, 잠정:50.1)  
18:00 유로존 8월 소매판매 MoM(예상:2.5%, 이전:-1.3%)  
22:45 미국 9월 마킷 종합 PMI(F)(예상:--, 잠정:54.4)  
23:00 미국 9월 ISM 서비스지수(예상:56.2, 이전:56.9)

## 의 일(10/06)

- 08:00 한국 9월 CPI YoY(예상:--, 이전:0.7%)  
15:00 독일 8월 제조업수주 MoM(예상:--, 이전:2.8%)  
21:30 미국 8월 무역수지(예상:~\$64.9b, 이전:~\$63.6b)  
22:00 유럽 ECB 라가르드 총재 연설

## USD Futures &amp; Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD010	1,170.00	-2.80	1,167.40	1,170.90	1,167.30	3.60	288,508	40,698	742,782	-43,263
USD011	1,169.30	-3.70	1,167.50	1,170.70	1,167.50	3.20	3,532	-1,228	6,827	-1,277
USD SPOT	1,169.50	-4.10	1,167.50	1,171.20	1,167.50	3.70	6,458	706	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	48,597	76,743	-28,146	-72,442	78,390
은행	3,572	4,054	-482	9,017	19,648
투신	1,799	2,293	-494	-3,788	-13,350
보험	419	1,977	-1,558	-509	3,076
기타법인	4,305	4,953	-648	-8,506	14,864
개인	33,686	26,481	7,205	-6,290	8,877
외국인	199,832	175,769	24,063	82,558	-111,525

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,327.89	19.81
국고채3Y	0.846	0.003
국고채10Y	1.430	0.004

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	26.357	0.082

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-736	-4,722	-6,569
KOSDAQ	-608	604	-2,077
국고채	6,101	7,341	55,504
통안채	0	5,394	18,839

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14000	0.00050
Call	0.530	0.050	3M	0.23350	-0.00050
CD	0.630	0.000	6M	0.24475	-0.00575
통안1년	0.674	0.003	12M	0.35750	-0.00238

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,682.81	-134.09	-0.48	1.87
S&P	3,348.44	-32.36	-0.96	1.52
나스닥	11,075.02	-251.49	-2.22	1.48
FTSE 100	5,902.12	22.67	0.39	1.02
DAX 30	12,689.04	-41.73	-0.33	1.76
Nikkei 225	23,029.90	-155.22	-0.67	-0.75
Shanghai	3,218.05	-6.31	-0.20	-1.88
항셍 H	9,397.37	115.85	1.25	-1.69
미국채 2년	0.13	0.00	1.50	0.00
미국채 10년	0.70	0.02	3.41	7.04
WTI	37.05	-1.67	-4.31	-7.95
Gold	1,908.64	10.74	0.57	2.03

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.00	-0.05
3M	-0.15	-0.15
6M	-0.60	-0.10
12M	-1.80	-0.20

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.080	0.005
2Y	-0.065	0.005
3Y	-0.060	0.005
4Y	-0.035	0.005
5Y	0.030	0.010

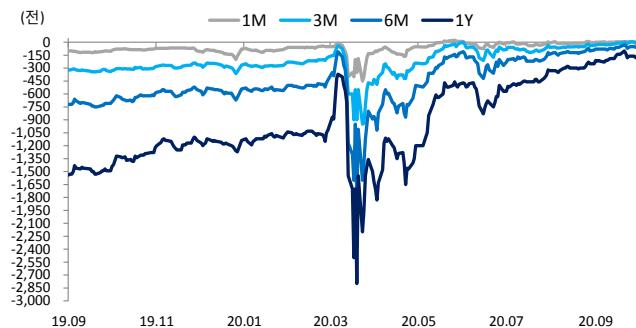
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.844	0.133	-0.84	USD/KRW	1,169.60	-3.90	0.39	USD/RUB	78.1920	0.8482	0.00
EUR/USD	1.1716	-0.0032	0.73	USD/CNY	6.7908	-0.0251	-0.27	USD/BRL	5.6861	0.0400	2.22
USD/JPY	105.29	-0.24	-0.27	USD/HKD	7.7503	0.0002	0.00	USD/ZAR	16.5283	-0.0804	-3.52
GBP/USD	1.2935	0.0044	1.48	USD/SGD	1.3638	0.0003	-1.00	USD/MXN	21.6163	-0.2091	-3.22
USD/CHF	0.9206	0.0017	-0.83	USD/TWD	29.039	-0.037	-0.39	USD/PLN	3.8438	0.0286	-1.65
AUD/USD	0.7161	-0.0024	1.85	USD/INR	73.15	-0.62	-1.03	USD/TRY	7.7748	0.0315	1.45
NZD/USD	0.6641	0.0005	1.45	USD/IDR	14,865	30	-0.05	USD/SEK	8.9357	0.0219	-2.11
USD/CAD	1.3308	0.0019	-0.58	USD/THB	31.600	0.023	0.03	USD/NOK	9.3163	0.0152	-2.69

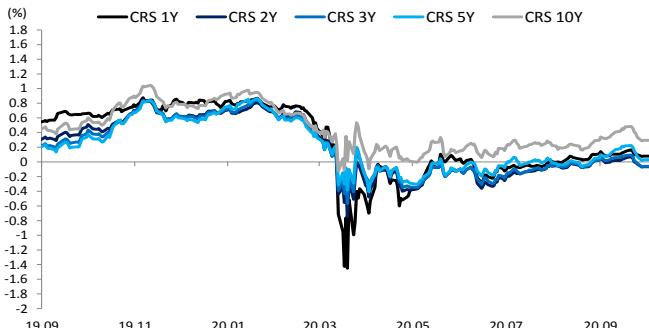
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



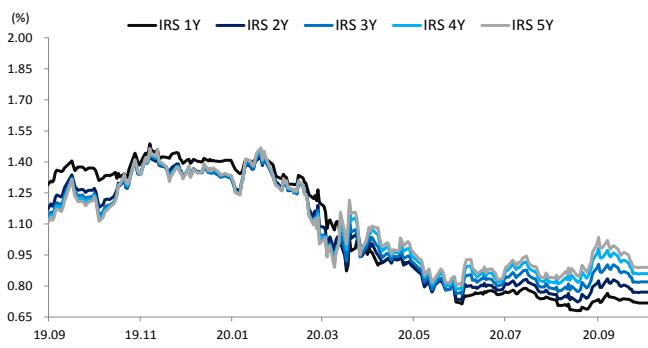
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



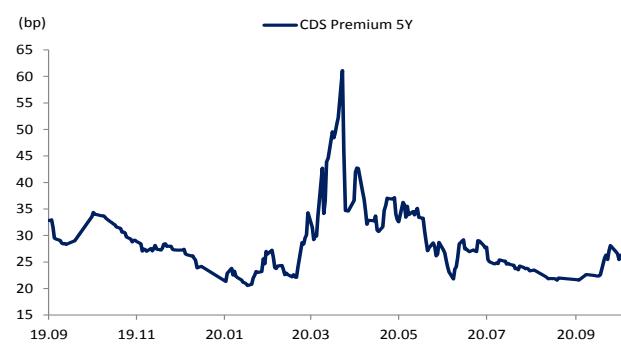
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



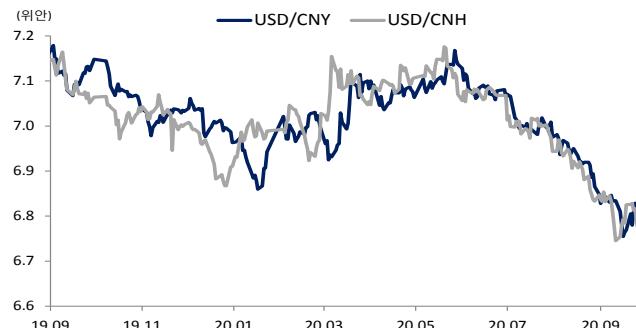
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



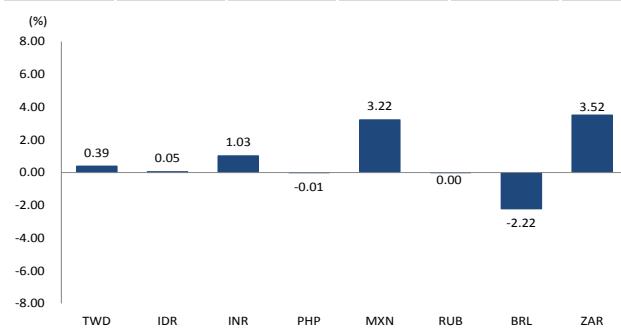
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터