

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

## ◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD010	1163.60	▼6.4	6.0	736,565
USD011	1163.30	▼6.0	5.7	6,351
USD/KRW	1163.40	▼6.1	5.4	
USD/CNY	6.7908	▼0.0029	0.0083	

## ◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.466	▼0.3780	UST2Y	0.1447
EUR/USD	1.1783	▲0.0067	UST10Y	0.7817
USD/JPY	105.75	▲0.4600	UST30Y	1.5892
GBP/USD	1.2979	▲0.0044	WTI	39.22

## 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(10/05)	
16:55	독일 9월 마킷 종합 PMI(F) <b>(결과:54.7, 잠정:53.7)</b>
17:00	유로존 9월 마킷 종합PMI(F) <b>(결과:50.4, 잠정:50.1)</b>
18:00	유로존 8월 소매판매 MoM <b>(결과:4.4%, 이전:-1.8%)</b>
22:45	미국 9월 마킷 종합 PMI(F) <b>(결과:54.3, 잠정:54.4)</b>
23:00	미국 9월 ISM 서비스지수 <b>(결과:57.8, 이전:56.9)</b>

금 일(10/06)	
08:00	한국 9월 CPI YoY(예상:0.4%, 이전:0.7%)
15:00	독일 8월 제조업수주 MoM(예상:2.9%, 이전:2.8%)
21:30	미국 8월 무역수지(예상:~\$64.9b, 이전:~\$63.6b)
22:00	유럽 ECB 라가르드 총재 연설 (10/06)
00:30	유럽 ECB 필립 레인 수석 이코노미스트 연설
00:45	미국 Fed 패트릭 하커(필라델피아, 투표권O) 총재 연설

익 일(10/07)	
15:00	독일 8월 산업생산 MoM(예상:1.7%, 이전:1.2%)
20:00	미국 MBA 주택용자 신청지수(예상:--, 이전:-4.8%)
23:30	미국 DOE 주간 원유재고(예상:--, 이전:-1980k) (10/08)
03:00	미국 FOMC 회의록
04:00	미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권O) 총재 연설
05:30	미국 Fed 칠스 예반스(시카고) 총재 연설

## USD Futures &amp; Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD010	1,163.60	-6.40	1,167.00	1,167.10	1,161.10	6.00	273,354	-15,154	736,565	-6,217
USD011	1,163.30	-6.00	1,166.70	1,166.90	1,161.20	5.70	7,175	3,643	6,351	-476
USD SPOT	1,163.40	-6.10	1,166.50	1,166.50	1,161.10	5.40	6,390	-68	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	46,948	87,427	-40,479	-82,303	50,947
은행	4,447	471	3,976	4,318	23,524
투신	4,493	2,983	1,510	-1,662	-10,981
보험	2	187	-185	-980	3,279
기타법인	9,245	3,540	5,705	-1,281	22,658
개인	31,593	23,565	8,028	-1,929	23,255
외국인	184,417	163,052	21,365	83,797	-112,782

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,358.00	30.11
국고채3Y	0.881	0.035
국고채10Y	1.479	0.049

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	25.741	0.111

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	1,740	-2,405	-2,269
KOSDAQ	-45	432	-3,584
국고채	4,471	10,437	55,470
통안채	999	6,401	21,146

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14275	0.00275
Call	0.480	0.000	3M	0.22025	-0.01325
CD	0.630	0.000	6M	0.23375	-0.01100
통안1년	0.692	0.018	12M	0.34875	-0.00875

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	28,148.64	465.83	1.68	2.05
S&P	3,408.63	60.19	1.80	1.70
나스닥	11,332.49	257.47	2.32	1.93
FTSE 100	5,942.94	40.82	0.69	0.25
DAX 30	12,828.31	139.27	1.10	-0.33
Nikkei 225	23,312.14	282.24	1.23	-0.85
Shanghai	3,218.05	-6.31	-0.20	-1.88
항셍 H	9,447.99	50.62	0.54	0.82
미국채 2년	0.14	0.02	12.26	15.76
미국채 10년	0.78	0.08	11.59	19.75
WTI	39.35	2.30	6.21	-3.08
Gold	1,916.41	16.57	0.87	2.23

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	-0.10	-0.10
3M	-0.30	-0.15
6M	-0.80	-0.20
12M	-2.10	-0.30

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.065	-0.015
2Y	-0.045	0.020
3Y	-0.040	0.020
4Y	-0.015	0.020
5Y	0.050	0.020

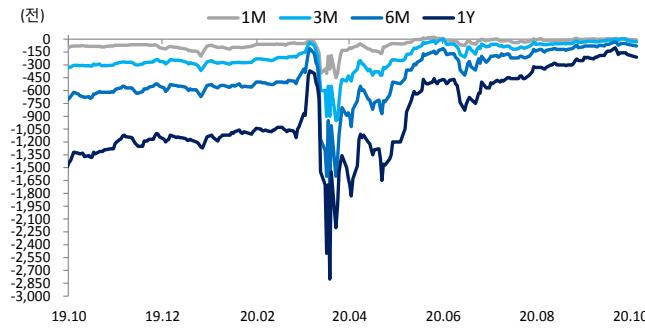
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.466	-0.378	-0.86	USD/KRW	1,163.40	-6.20	-0.86	USD/RUB	78.1044	-0.0876	-1.22
EUR/USD	1.1783	0.0067	1.00	USD/CNY	6.7908	-0.0251	-0.27	USD/BRL	5.5755	-0.1106	-1.53
USD/JPY	105.75	0.46	0.24	USD/HKD	7.7502	-0.0001	0.00	USD/ZAR	16.5837	0.0554	-2.77
GBP/USD	1.2979	0.0044	1.13	USD/SGD	1.3607	-0.0031	-0.90	USD/MXN	21.3972	-0.2191	-4.55
USD/CHF	0.9154	-0.0052	-1.05	USD/TWD	29.039	-0.037	-0.39	USD/PLN	3.8147	-0.0291	-2.97
AUD/USD	0.7181	0.0020	1.56	USD/INR	73.29	-0.48	-0.67	USD/TRY	7.7615	-0.0133	-0.57
NZD/USD	0.6646	0.0005	1.40	USD>IDR	14,800	-65	-0.67	USD/SEK	8.9001	-0.0356	-1.58
USD/CAD	1.3263	-0.0045	-0.80	USD/THB	31.415	-0.185	-1.00	USD/NOK	9.2159	-0.1004	-2.79

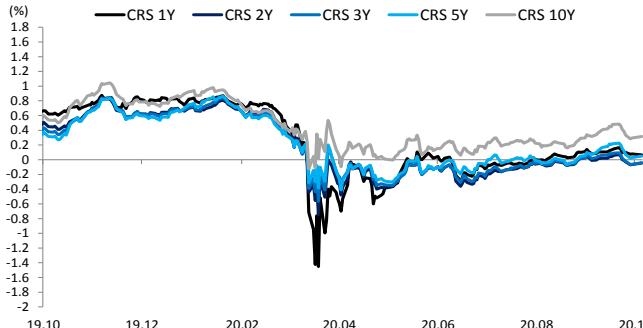
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



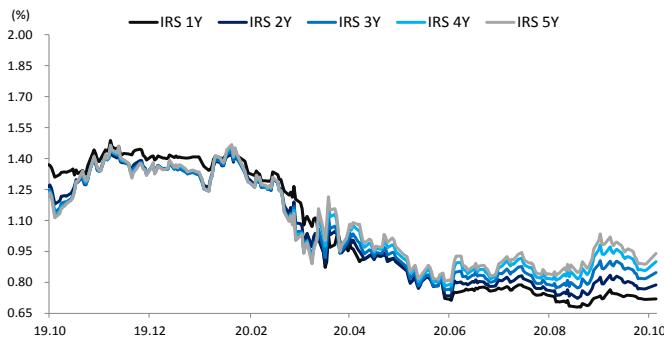
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



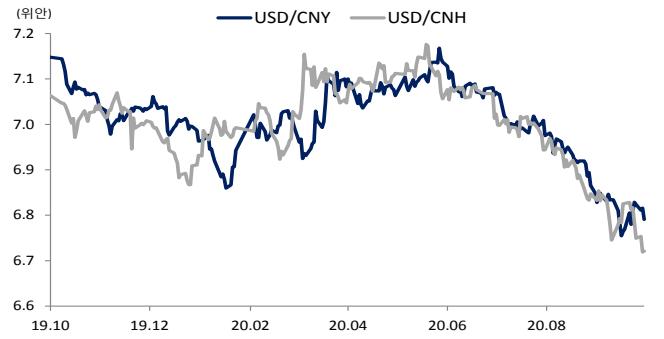
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



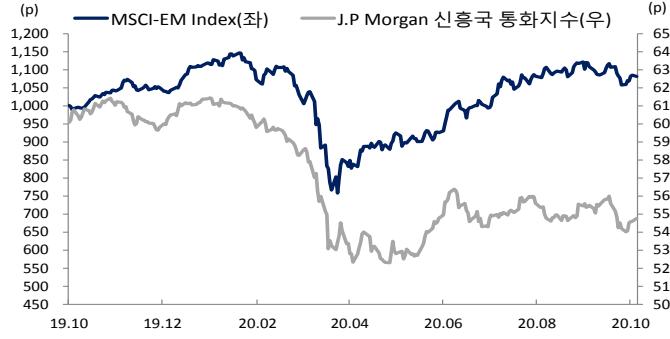
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



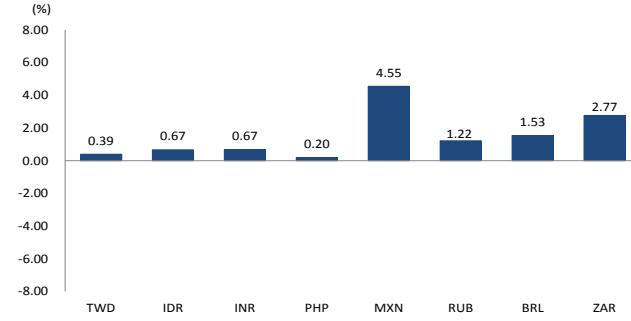
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터