

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD010	1161.30	▼2.3	5.1	726,139
USD011	1161.10	▼2.2	4.8	7,350
USD/KRW	1161.00	▼2.4	5.2	
USD/CNY	6.7908	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.834	▲0.3210	UST2Y	0.1467
EUR/USD	1.1734	▼0.0049	UST10Y	0.7353
USD/JPY	105.63	▼0.1200	UST30Y	1.5366
GBP/USD	1.2881	▼0.0098	WTI	40.67

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(10/06)	금 일(10/07)	의 일(10/08)
21:30 미국 8월 무역수지(결과:-\$67.1b, 예상:-\$63.4b)	15:00 독일 8월 산업생산 MoM(예상:1.7%, 이전:1.2%)	10:45 중국 9월 차이신 종합 PMI(예상:--, 이전:55.1)
22:00 유럽 ECB 라가르드 총재 연설 (10/06)	20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수(예상:--, 이전:-4.8%)	10:45 중국 9월 차이신 서비스업 PMI(예상:--, 이전:54.0)
00:30 유럽 ECB 필립 레인 수석 이코노미스트 연설	23:30 미국 DOE 주간 원유재고(예상:--, 이전:-1980k) (10/08)	17:00 유럽 ECB 루이 데 칸도스 부총재 연설
00:45 미국 Fed 패트릭 하커(필라델피아, 투표권) 총재 연설	03:00 미국 FOMC 회의록 공개	21:30 미국 주간 신규실업수당 청구건수(예상:820k, 이전:837k)
	04:00 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권) 총재 연설	
	05:30 미국 Fed 찰스 에반스(시카고) 총재 연설	

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD010	1,161.30	-2.30	1,157.50	1,162.20	1,157.10	5.10	325,329	51,975	726,139	-10,426
USD011	1,161.10	-2.20	1,159.20	1,162.10	1,157.30	4.80	8,268	1,093	7,350	999
USD SPOT	1,161.00	-2.40	1,158.00	1,162.20	1,157.00	5.20	8,096	1,706	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	67,655	100,640	-32,985	-122,005	16,829
은행	422	6,034	-5,612	-2,793	18,735
투신	2,995	6,499	-3,504	-2,824	-14,311
보험	9	440	-431	-1,557	3,097
기타법인	5,048	6,912	-1,864	65	22,236
개인	21,903	30,177	-8,274	-2,186	15,114
외국인	236,209	183,439	52,770	131,360	-61,700

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,365.90	7.90
국고채3Y	0.905	0.024
국고채10Y	1.531	0.052

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	25.056	0.166

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	1,726	1,243	-2,482
KOSDAQ	-568	228	-4,083
국고채	657	9,171	55,385
통안채	2,223	6,422	23,871

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.13963	-0.00312
Call	0.480	0.000	3M	0.22975	0.00950
CD	0.630	0.000	6M	0.23925	0.00550
통안1년	0.706	0.014	12M	0.34388	-0.00487

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,772.76	-375.88	-1.34	1.17
S&P	3,360.95	-47.68	-1.40	0.76
나스닥	11,154.60	-177.89	-1.57	0.63
FTSE 100	5,949.94	7.00	0.12	0.89
DAX 30	12,906.02	77.71	0.61	0.63
Nikkei 225	23,433.73	121.59	0.52	-0.45
Shanghai	3,218.05	-6.31	-0.20	-1.88
항셍 H	9,536.49	88.50	0.94	2.51
미국채 2년	0.15	0.00	1.38	19.27
미국채 10년	0.74	-0.05	-5.94	13.21
WTI	40.67	1.45	3.70	3.51
Gold	1,903.97	-12.44	-0.65	0.44

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.00	0.10
3M	-0.20	0.10
6M	-0.60	0.20
12M	-1.90	0.20

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.080	0.015
2Y	-0.010	0.035
3Y	0.000	0.040
4Y	0.030	0.045
5Y	0.105	0.055

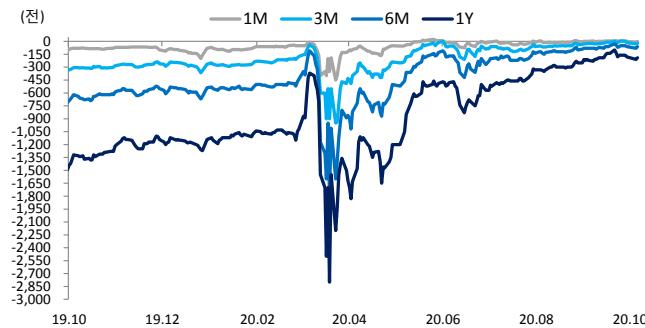
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.834	0.321	-0.06	USD/KRW	1,161.05	-2.35	-0.73	USD/RUB	78.4357	0.3313	-0.80
EUR/USD	1.1734	-0.0049	-0.09	USD/CNY	6.7908	-0.0251	-0.27	USD/BRL	5.5936	0.0181	-0.70
USD/JPY	105.63	-0.12	-0.03	USD/HKD	7.7501	-0.0001	0.00	USD/ZAR	16.7326	0.1489	-1.19
GBP/USD	1.2881	-0.0098	0.14	USD/SGD	1.3629	0.0022	-0.43	USD/MXN	21.7282	0.3310	-3.25
USD/CHF	0.9180	0.0026	-0.18	USD/TWD	29.039	-0.037	-0.39	USD/PLN	3.8223	0.0076	-0.90
AUD/USD	0.7102	-0.0079	-0.39	USD/INR	73.46	0.17	-0.54	USD/TRY	7.7990	0.0375	-0.10
NZD/USD	0.6587	-0.0059	-0.02	USD/IDR	14,735	-65	-1.07	USD/SEK	8.9605	0.0604	-0.07
USD/CAD	1.3312	0.0049	-0.57	USD/THB	31.190	-0.225	-1.38	USD/NOK	9.3638	0.1479	-0.61

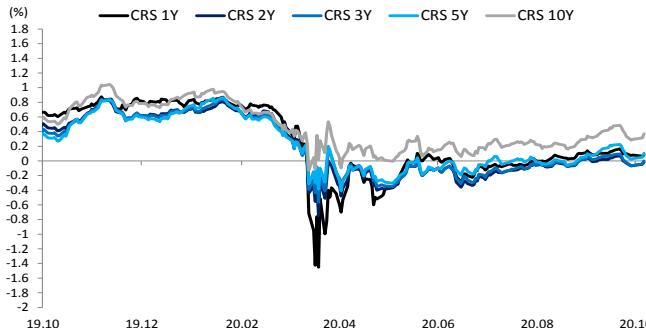
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



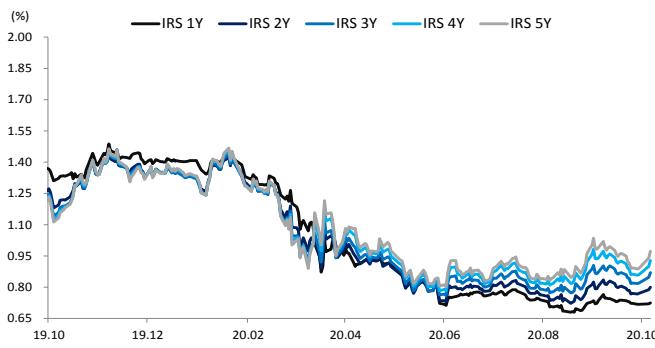
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



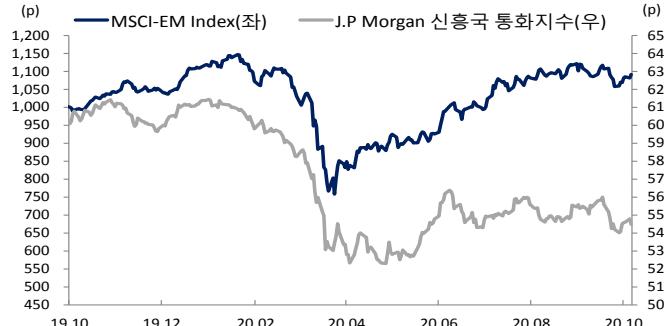
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



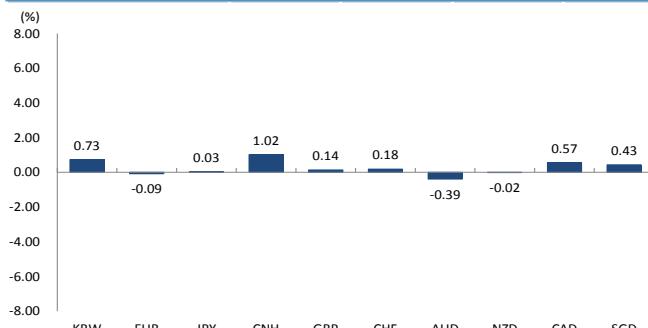
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



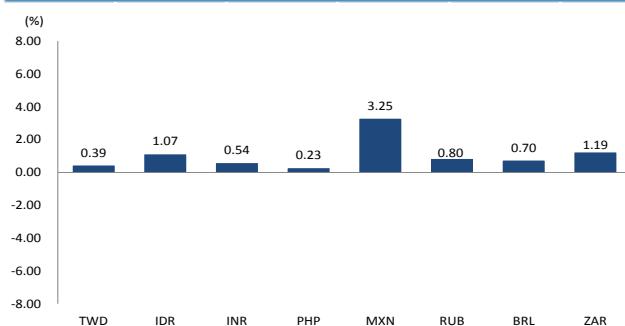
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터