

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD010	1147.10	▼5.7	4.0	730,451
USD011	1147.50	▼5.3	3.7	27,871
USD/KRW	1146.80	▼6.5	3.7	
USD/CNY	6.7172	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

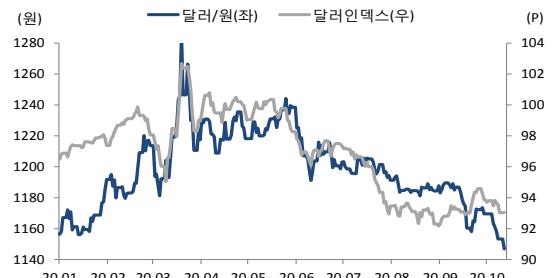
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.052	▼0.0050	UST2Y	휴장
EUR/USD	1.1813	▼0.0013	UST10Y	휴장
USD/JPY	105.33	▼0.2900	UST30Y	휴장
GBP/USD	1.3064	▲0.0028	WTI	39.43

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(10/12)

15:00 일본 8월 공작기계수주 MoM(P)(결과:-15.0%, 이전:-23.2%)

금 일(10/13)

15:00 독일 9월 CPI YoY(F)(예상:--, 잠정:-0.2%)

의 일(10/14)

08:30 호주 10월 웨스트팩 소비자기대지수(예상:--, 이전:93.8)

18:00 독일 10월 ZEW 서베이(예상:--, 이전:77.4)

13:30 일본 8월 산업생산 MoM(F)(예상:--, 이전:9.6%)

19:00 미국 9월 NFIB 소기업 낙관지수(예상:101.2, 이전:100.2)

20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수(예상:--, 이전:4.6%)

21:30 미국 9월 CPI YoY(예상:1.4%, 이전:1.3%)

21:30 미국 9월 PPI YoY(예상:0.2%, 이전:-0.2%)

N/A 중국 9월 수출 YoY(예상:-9.5%, 이전:9.5%)

22:00 미국 Fed 리처드 클라리다 부의장 연설

N/A 중국 9월 수입 YoY(예상:-0.3%, 이전:-2.1%)

23:30 미국 은행 10월 금통위 기준금리 결정(예상:기준금리 동결)

N/A 중국 9월 무역수지(예상:\$59.25b, 이전:\$58.93b)

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD010	1,147.10	-5.70	1,147.50	1,150.80	1,146.80	4.00	287,672	-17,584	730,451	-6,937
USD011	1,147.50	-5.30	1,147.80	1,150.70	1,147.00	3.70	13,005	4,644	27,871	5,508
USD SPOT	1,146.80	-6.50	1,150.00	1,150.50	1,146.80	3.70	5,903	-930	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	70,225	84,111	-13,886	-81,439	-32,524
은행	1,831	4,073	-2,242	-11,800	6,795
투신	1,838	5,318	-3,480	-6,480	-23,380
보험	769	1,455	-686	-3,487	-482
기타법인	11,216	11,665	-449	16,569	35,097
개인	34,745	36,176	-1,431	12,821	20,457
외국인	192,685	170,511	22,174	73,836	-5,963

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,403.73	11.77
국고채3Y	0.925	0.018
국고채10Y	1.553	0.010

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	24.089	-0.004

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	1,392	11,508	13,045
KOSDAQ	-204	-384	-2,518
국고채	-5,462	4,114	38,927
통안채	-1	13,059	31,197

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14425	-0.00100
Call	0.600	0.120	3M	0.22888	0.00475
CD	0.630	0.000	6M	0.24288	-0.00287
통안1년	0.702	0.003	12M	0.34763	0.00000

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	28,837.52	250.62	0.88	2.45
S&P	3,534.22	57.09	1.64	3.68
나스닥	11,876.26	296.32	2.56	4.80
FTSE 100	6,001.38	-15.27	-0.25	0.98
DAX 30	13,138.41	87.18	0.67	2.42
Nikkei 225	23,558.69	-61.00	-0.26	1.06
Shanghai	3,358.47	86.39	2.64	4.32
항셍 H	9,878.74	260.89	2.71	4.56
미국채 2년	0.15	0.00	0.00	5.67
미국채 10년	0.77	0.00	0.00	-1.02
WTI	39.43	-1.17	-2.88	0.54
Gold	1,924.94	-5.46	-0.28	0.45

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.10	0.05
3M	-0.15	0.05
6M	-0.50	0.10
12M	-1.80	0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.105	0.005
2Y	0.065	0.010
3Y	0.085	0.020
4Y	0.110	0.020
5Y	0.190	0.020

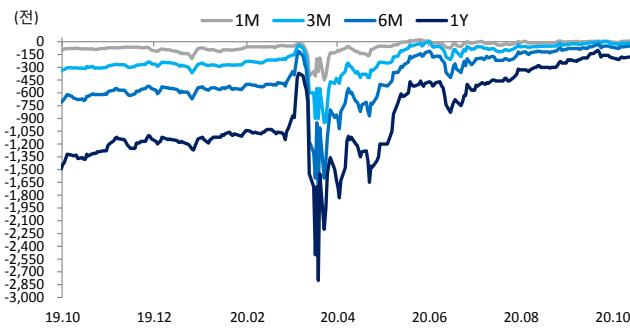
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.052	-0.005	-0.49	USD/KRW	1,147.00	-6.40	-1.41	USD/RUB	77.1300	0.3500	-1.25
EUR/USD	1.1813	-0.0013	0.25	USD/CNY	6.7459	0.0512	-0.66	USD/BRL	5.5327	-0.0609	-2.70
USD/JPY	105.33	-0.29	-0.40	USD/HKD	7.7500	-0.0001	0.00	USD/ZAR	16.5117	0.0442	-0.43
GBP/USD	1.3064	0.0028	0.65	USD/SGD	1.3572	0.0024	-0.26	USD/MXN	21.2033	0.0646	-0.91
USD/CHF	0.9091	-0.0016	-0.69	USD/TWD	28.756	-0.320	-0.97	USD/PLN	3.7758	-0.0031	-1.02
AUD/USD	0.7209	-0.0031	0.39	USD/INR	73.27	0.14	-0.02	USD/TRY	7.8957	0.0212	1.73
NZD/USD	0.6647	-0.0019	0.02	USD/IDR	14,700	0	-0.68	USD/SEK	8.8095	0.0274	-1.02
USD/CAD	1.3114	-0.0007	-1.12	USD/THB	31.185	0.115	-0.73	USD/NOK	9.1376	0.0004	-0.85

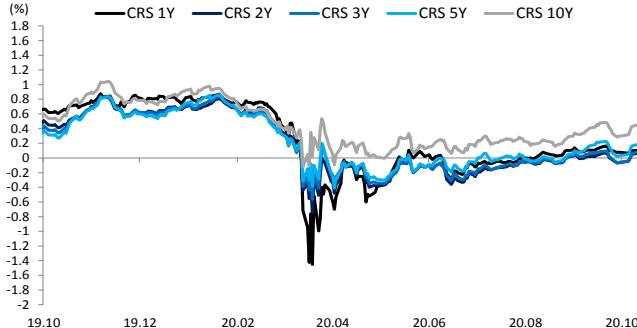
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



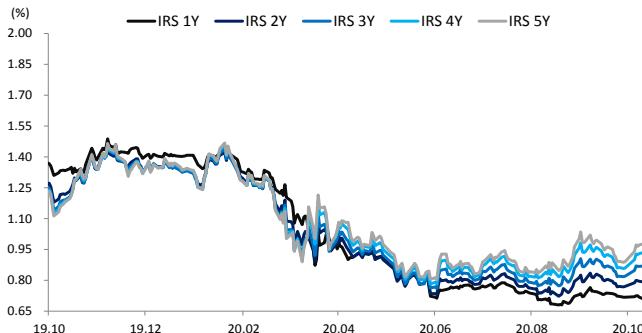
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



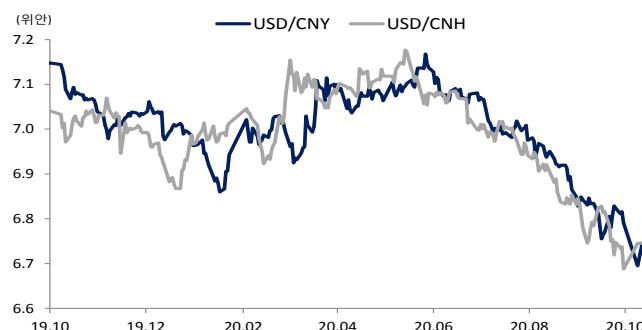
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



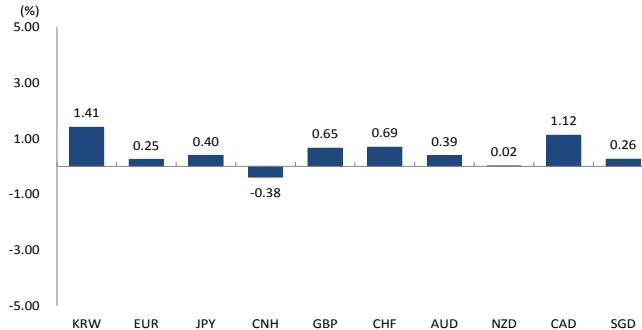
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



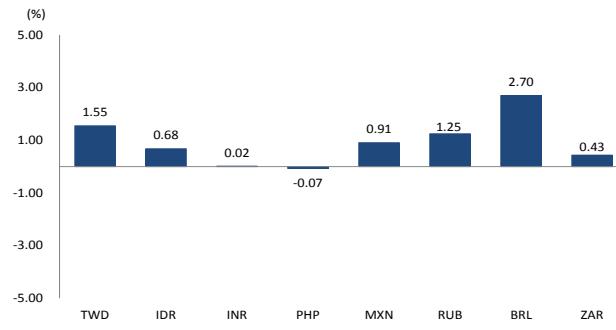
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터