

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD011	1,139.40	▼3.4	3.3	755,161
USD012	1,139.50	▼2.8	2.7	680
USD/KRW	1,139.40	▼2.6	3.3	
USD/CNY	6.6826	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

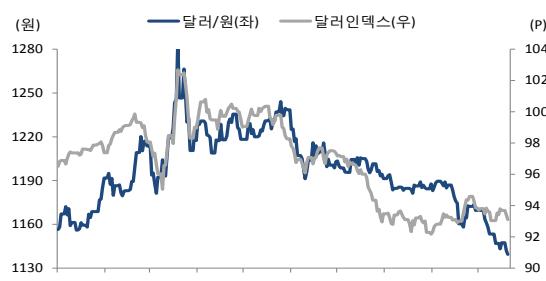
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.083	▼0.3440	UST2Y	0.1431
EUR/USD	1.1822	▲0.0053	UST10Y	0.7857
USD/JPY	105.50	▲0.0700	UST30Y	1.5915
GBP/USD	1.2948	▲0.0000	WTI	41.46

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(10/20)

21:30 미국 9월 주택착공건수(결과:1415k, 예상:1388k)
22:00 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권O) 총재 연설
23:50 미국 Fed 렌들 월스 부의장 연설

금 일(10/21)

15:00 영국 9월 CPI YoY(예상:0.6%, 이전:0.2%)
19:00 유럽 ECB 루이스 디 콘도스 부총재 연설
23:30 미국 DOE 주간 원유재고(예상:-1375k, 이전:-3818k)
(10/22)
01:00 미국 Fed 낸 카시카리(미니애폴리스, 투표권O) 총재 연설
01:00 미국 Fed 로버트 카풀란(댈러스, 투표권O) 총재 연설
03:00 미국 Fed 베이지북 공개

익 일(10/22)

15:00 독일 11월 Gfk소비자 기대지수(예상:-3.0, 이전:-1.6)
21:30 미국 주간 신규 실업수당 청구건수(예상:870k, 이전:898k)
23:00 미국 9월 선행지수(예상:0.6%, 이전:1.2%)
23:00 유럽 10월 소비자기대지수(예상:-15.0, 이전:-13.9)
(10/23)
00:00 미국 10월 캔자스시티 제조업활동(예상:11, 이전:11)
07:00 미국 Fed 로버트 카풀란(댈러스, 투표권O) 총재 연설

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD011	1,139.40	-3.40	1,141.10	1,141.60	1,138.30	3.30	266,821	-21,091	755,161	11,418
USD012	1,139.50	-2.80	1,141.00	1,141.20	1,138.50	2.70	1,082	742	680	191
USD SPOT	1,139.40	-2.60	1,140.50	1,141.50	1,138.20	3.30	7,687	801	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	76,151	54,990	21,161	24,237	13,614
은행	370	391	-21	12,533	29,762
투신	510	448	62	-1,532	-31,610
보험	341	204	137	7,222	4,836
기타법인	5,719	6,201	-482	1,630	23,528
개인	33,230	32,135	1,095	7,709	-3,799
외국인	151,713	173,565	-21,852	-51,799	-36,331

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,358.41	11.67
국고채3Y	0.911	0.020
국고채10Y	1.462	0.021

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	25.087	-0.018

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	437	-1,459	6,768
KOSDAQ	948	737	202
국고채	-922	2,222	16,970
통안채	0	2,687	24,978

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14575	0.00237
Call	0.530	0.130	3M	0.21575	0.00712
CD	0.630	0.000	6M	0.25188	-0.00237
통안1년	0.698	0.007	12M	0.33713	-0.00262

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	28,308.79	113.37	0.40	-1.29
S&P	3,443.12	16.20	0.47	-1.96
나스닥	11,516.49	37.61	0.33	-2.93
FTSE 100	5,889.22	4.57	0.08	-1.35
DAX 30	12,736.95	-117.71	-0.92	-2.17
Nikkei 225	23,567.04	-104.09	-0.44	-0.15
Shanghai	3,328.10	15.44	0.47	-0.94
항셍 H	9,988.33	10.17	0.10	1.11
미국채 2년	0.14	0.00	-1.38	2.95
미국채 10년	0.79	0.02	2.17	8.04
WTI	41.46	0.63	1.54	3.13
Gold	1,908.86	-0.88	-0.05	0.92

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.20	0.05
3M	-0.10	0.10
6M	-0.40	0.10
12M	-1.40	0.20

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.135	0.035
2Y	0.055	0.045
3Y	0.110	0.045
4Y	0.140	0.045
5Y	0.220	0.045

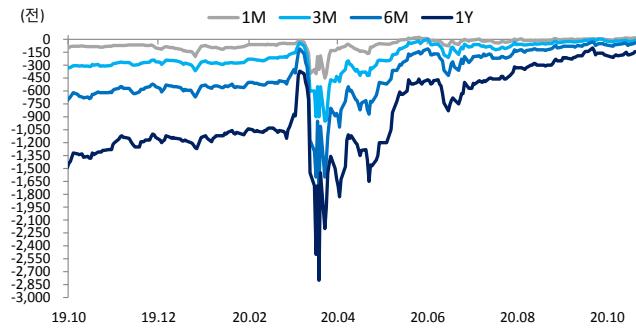
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93,083	-0.344	-0.48	USD/KRW	1,139.35	-2.65	-0.68	USD/RUB	77,356.8	-0.3034	0.41
EUR/USD	1.1822	0.0053	0.65	USD/CNY	6.6767	-0.0063	-1.04	USD/BRL	5.6059	-0.0045	0.63
USD/JPY	105.50	0.07	0.02	USD/HKD	7.7501	0.0000	0.00	USD/ZAR	16.4827	-0.0368	0.06
GBP/USD	1.2948	0.0000	0.09	USD/SGD	1.3574	-0.0004	-0.21	USD/MXN	21.1207	-0.0762	-1.05
USD/CHF	0.9071	-0.0028	-0.86	USD/TWD	28.810	-0.020	0.07	USD/PLN	3.8602	-0.0260	0.88
AUD/USD	0.7048	-0.0026	-1.58	USD/INR	73.47	0.10	0.16	USD/TRY	7.8658	-0.0178	-0.66
NZD/USD	0.6581	-0.0025	-1.05	USD/IDR	14,658	-50	-0.46	USD/SEK	8.7480	-0.0812	-0.94
USD/CAD	1.3129	-0.0063	-0.08	USD/THB	31.278	0.076	0.30	USD/NOK	9.2838	-0.0352	0.51

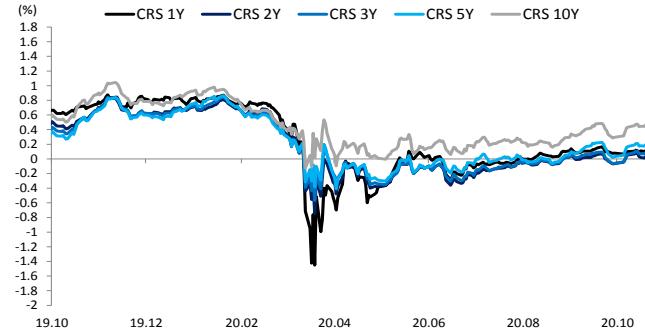
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



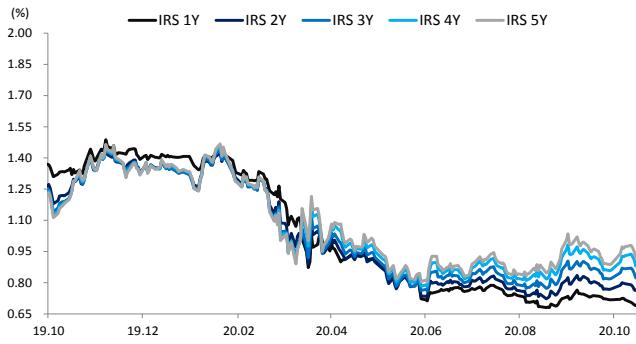
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



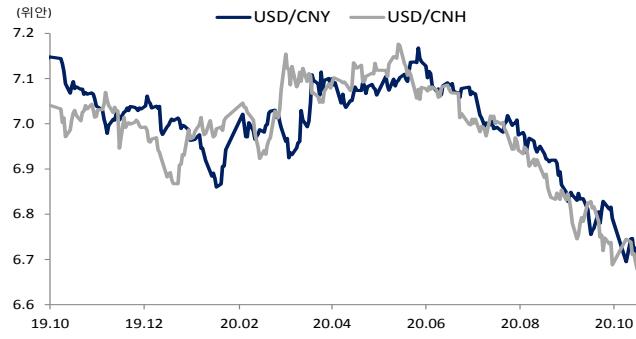
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



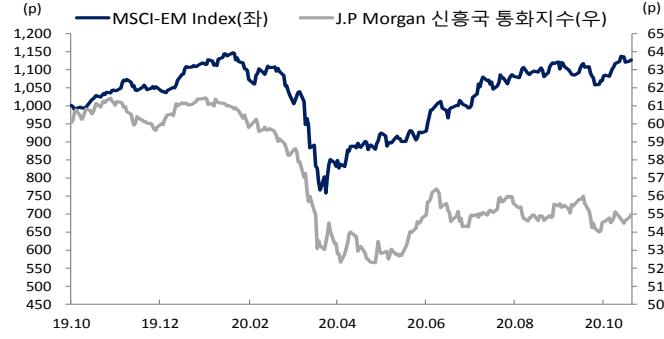
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



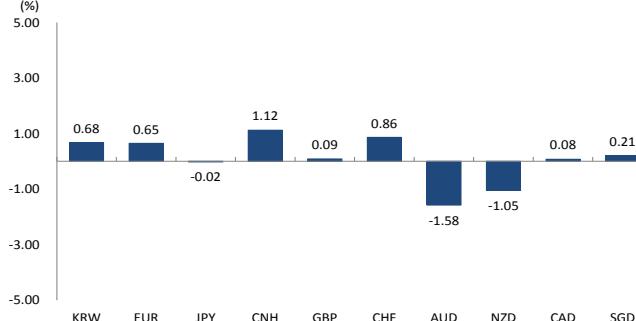
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



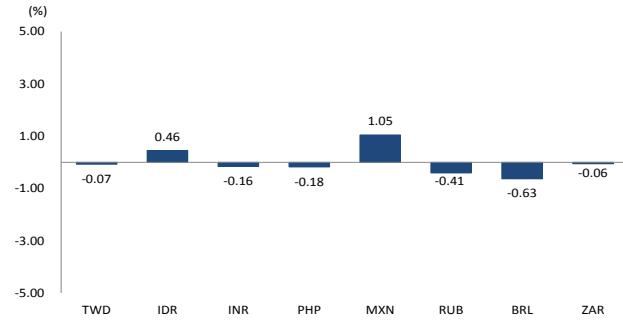
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터