

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

2차 팬데믹에 대한 우려

금일 달러/원 예상 : 1,130.00~1,137.00

NDF 최종호가 : 1,132.50/1,133.00(+4.85)

야간달러선물 종가 : 1,132.70원 | 고가:1,133.10원 | 저가:1,128.70원

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD011	1,127.60	▼5.4	3.2	753,137
USD012	1,127.70	▼5.7	3.1	2,400
USD/KRW	1,127.70	▼5.2	3	
USD/CNY	6.6829	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

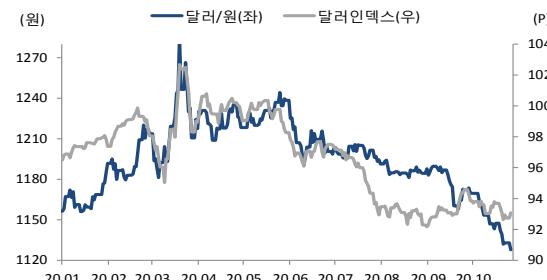
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.067	▲0.2990	UST2Y	0.1494
EUR/USD	1.1810	▼0.0050	UST10Y	0.8010
USD/JPY	104.84	▲0.1300	UST30Y	1.5909
GBP/USD	1.3024	▼0.0015	WTI	38.56

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(10/26)

- 18:00 독일 10월 Ifo기업환경지수(결과:92.7, 이전:93.2)
- 21:30 미국 9월 시카고 연방국가지수(결과:0.27, 이전:1.11)
- 23:00 미국 9월 신규주택매매(결과:959k, 이전:994k)
- 23:30 미국 10월 달러스연은지수(결과:19.8, 이전:13.6)

금 일(10/27)

- 08:00 한국 3분기 GDP QoQ(P)(예상:-1.5%, 이전:-2.7%)
- 18:00 유럽 9월 M3 통화공급 YoY(예상:--, 이전:9.5%)
- 21:00 미국 9월 내구재주문(P)(예상:1.0%, 이전:0.5%)
- 23:00 미국 10월 CB 소비자기대지수(예상:101.9, 이전:101.8)
- 23:00 미국 10월 리치몬드 연방 제조업지수(예상:18, 이전:21)

의 일(10/28)

- 09:30 호주 3분기 CPI YoY(예상:0.7%, 이전:-0.3%)
- 16:45 프랑스 10월 소비자기대지수(예상:93, 이전:95)
- 20:00 미국 MBA 주택용자 신청지수(예상:--, 이전:-0.6%)
- 21:30 미국 9월 도매재고 MoM(P)(예상:0.4%, 이전:0.4%)
- 23:30 미국 DOE 주간 원유재고(예상:--, 이전:-1002k)

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD011	1,127.60	-5.40	1,130.00	1,130.70	1,127.50	3.20	252,529	20,770	753,137	-13,533
USD012	1,127.70	-5.70	1,129.90	1,130.80	1,127.70	3.10	2,676	857	2,400	833
USD SPOT	1,127.70	-5.20	1,130.00	1,130.70	1,127.70	3.00	5,942	-1,043	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	62,594	74,439	-11,845	6,767	-119,325
은행	80	150	-70	13,103	22,398
투신	1,237	1,799	-562	-1,786	-14,887
보험	20	140	-120	-421	2,002
기타법인	4,650	4,123	527	1,569	13,823
개인	27,373	25,907	1,466	6,708	11,686
외국인	159,658	149,084	10,574	-25,920	84,283

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,343.91	-16.90
국고채3Y	0.908	-0.002
국고채10Y	1.482	-0.013

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	24.715	-0.126

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-1,437	-1,592	5,435
KOSDAQ	338	773	168
국고채	115	-2,437	12,186
통안채	1,384	3,982	28,418

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.15150	-0.00475
Call	0.480	0.150	3M	0.22225	0.00575
CD	0.630	0.000	6M	0.24625	-0.00313
통안1년	0.694	-0.002	12M	0.33200	-0.00463

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,685.38	-650.19	-2.29	-1.81
S&P	3,400.97	-64.42	-1.86	-0.76
나스닥	11,358.94	-189.34	-1.64	-1.04
FTSE 100	5,792.01	-68.27	-1.16	-1.57
DAX 30	12,177.18	-468.57	-3.71	-5.27
Nikkei 225	23,494.34	-22.25	-0.09	-0.75
Shanghai	3,251.12	-26.88	-0.82	-1.86
항셍 H	10,125.59	40.41	0.40	2.12
미국채 2년	0.15	-0.01	-3.86	2.96
미국채 10년	0.80	-0.04	-4.97	4.16
WTI	38.56	-1.29	-3.24	-5.56
Gold	1,902.60	0.55	0.03	-0.37

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.20	0.05
3M	0.00	0.15
6M	-0.30	0.10
12M	-1.10	0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.155	0.025
2Y	0.120	0.015
3Y	0.175	0.015
4Y	0.205	0.015
5Y	0.275	0.015

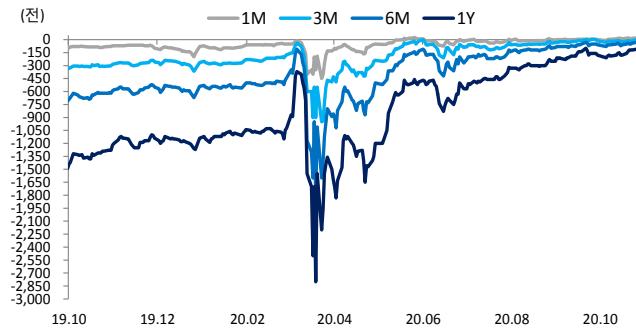
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.067	0.299	-0.39	USD/KRW	1,127.85	-5.00	-1.24	USD/RUB	76.4435	0.3061	-1.57
EUR/USD	1.1810	-0.0050	0.35	USD/CNY	6.7122	0.0255	0.44	USD/BRL	5.6247	0.0056	0.25
USD/JPY	104.84	0.13	-0.56	USD/HKD	7.7501	0.0000	0.00	USD/ZAR	16.2260	0.0444	-1.78
GBP/USD	1.3024	-0.0015	0.59	USD/SGD	1.3614	0.0035	0.27	USD/MXN	20.9346	0.0657	-1.24
USD/CHF	0.9078	0.0034	-0.23	USD/TWD	28.753	-0.021	-0.27	USD/PLN	3.8769	0.0208	-0.24
AUD/USD	0.7123	-0.0016	0.69	USD/INR	73.85	0.24	0.65	USD/TRY	8.0860	0.1245	2.57
NZD/USD	0.6678	-0.0013	1.09	USD/IDR	14,650	-10	-0.39	USD/SEK	8.7452	-0.0022	-0.95
USD/CAD	1.3212	0.0087	0.15	USD/THB	31.278	0.038	0.24	USD/NOK	9.2446	0.0068	-0.80

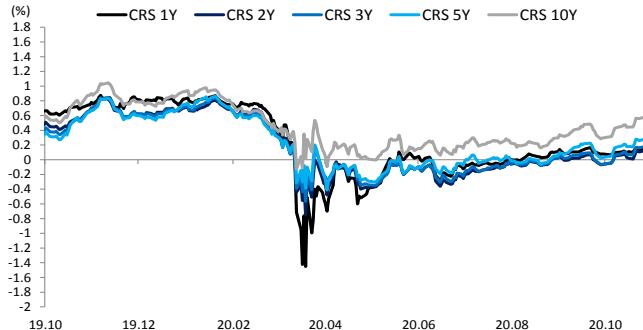
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



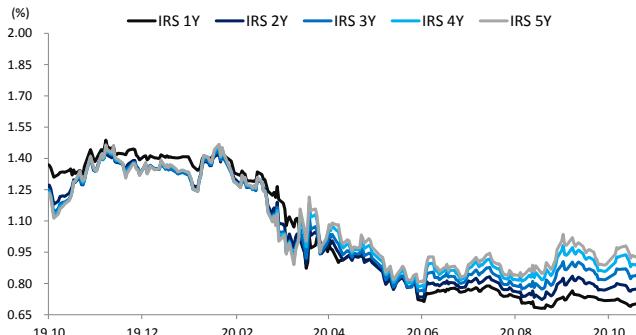
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



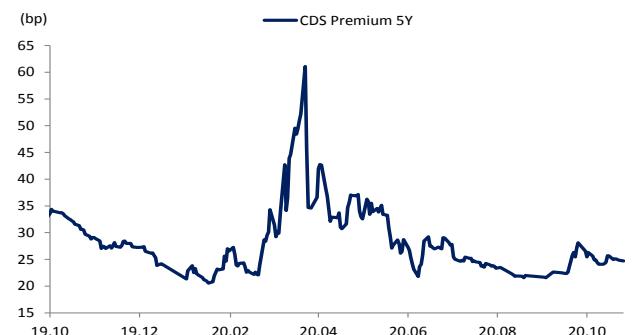
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



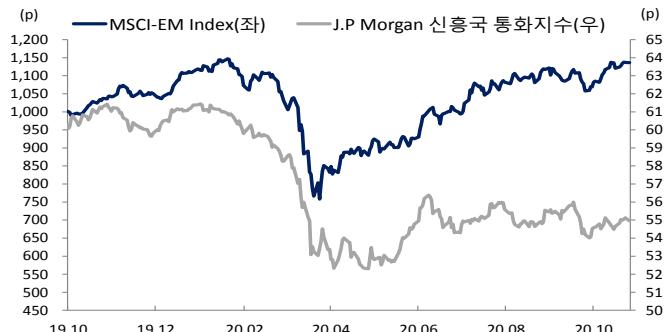
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



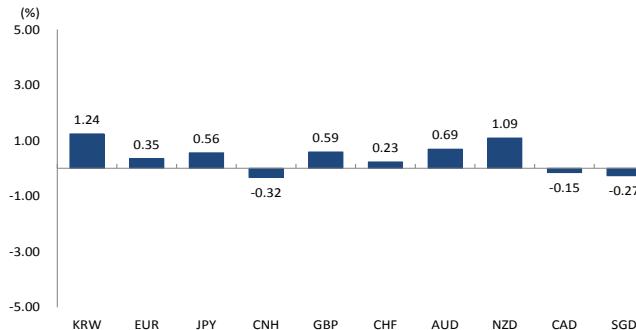
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



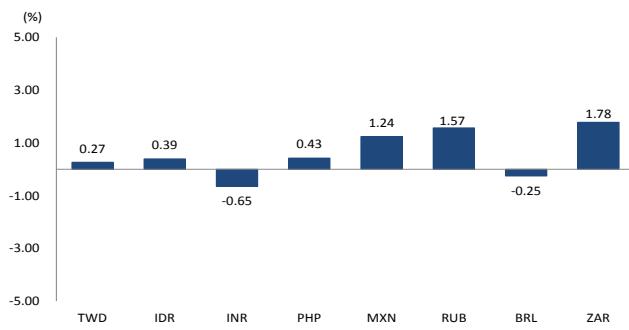
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터