

## FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

## ◇ 전일 국내시장 동향

| 종목      | 전일종가     | 전일비<br>(원) | 변동폭<br>(고가-저가) | 미결제약정<br>(계약) |
|---------|----------|------------|----------------|---------------|
| USD011  | 1,126.40 | ▼1.2       | 7.4            | 794,244       |
| USD012  | 1,126.10 | ▼1.6       | 6.5            | 5,855         |
| USD/KRW | 1,125.50 | ▼2.2       | 6.9            |               |
| USD/CNY | 6.6977   | ▼0.0029    | 0.0083         |               |

## ◇ 전일 해외시장 동향

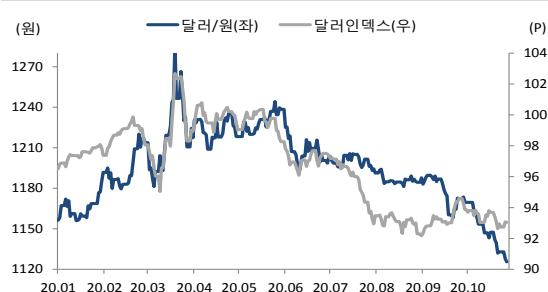
| 종목        | 전일종가   | 전일비(bp) | 종목     | 전일종가   |
|-----------|--------|---------|--------|--------|
| USD Index | 92.940 | ▼0.1050 | UST2Y  | 0.1453 |
| EUR/USD   | 1.1796 | ▼0.0014 | UST10Y | 0.7676 |
| USD/JPY   | 104.42 | ▼0.4200 | UST30Y | 1.5530 |
| GBP/USD   | 1.3044 | ▲0.0020 | WTI    | 39.57  |

## 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(10/27)

- 18:00 유럽 9월 M3 통화공급 YoY(결과: 10.4%, 이전: 9.5%)
- 21:00 미국 9월 내구재주문(P)(결과: 1.9%, 이전: 0.4%)
- 23:00 미국 10월 CB 소비자기대지수(결과: 100.9, 이전: 101.3)
- 23:00 미국 10월 리치몬드 연방 제조업지수(결과: 29, 이전: 21)

## 금 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 주택융자 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)

## 익 일(10/29)

- 06:00 한국 11월 기업경기실사 제조업(예상: -, 이전: 68)
- 17:55 독일 10월 실업자 변동(예상: -5.0k, 이전: -8.0k)
- 19:00 유로존 10월 소비자기대지수(F)(예상: -, 잠정: -15.5)
- 21:30 미국 신규 실업수당 청구건수(예상: 775k, 이전: 787k)
- 21:30 미국 3분기 GDP 연간화 QoQ(예상: 32.0%, 이전: -31.4%)
- 21:45 유럽 ECB 통화정책회의(예상: 기준금리 동결)

## USD Futures &amp; Spot

| 종목       | 종가       | 전일비   | 시가       | 고가       | 저가       | 변동폭  | 거래량     | 전일대비   | 미결제약정   | 전일대비   |
|----------|----------|-------|----------|----------|----------|------|---------|--------|---------|--------|
| USD011   | 1,126.40 | -1.20 | 1,132.60 | 1,132.60 | 1,125.20 | 7.40 | 325,120 | 72,591 | 794,244 | 41,107 |
| USD012   | 1,126.10 | -1.60 | 1,132.00 | 1,132.00 | 1,125.50 | 6.50 | 2,765   | 89     | 5,855   | 3,455  |
| USD SPOT | 1,125.50 | -2.20 | 1,132.00 | 1,132.00 | 1,125.10 | 6.90 | 9,042   | 3,100  | -       | -      |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

| 구분   | 매수      | 매도      | 순매수     | 5일누적    | 20일누적   |
|------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 금융투자 | 85,979  | 71,438  | 14,541  | 147     | -74,166 |
| 은행   | 20,783  | 120     | 20,663  | 33,787  | 34,386  |
| 투신   | 2,168   | 601     | 1,567   | -281    | -12,704 |
| 보험   | 117     | 83      | 34      | -524    | 1,750   |
| 기타법인 | 6,564   | 4,747   | 1,817   | 3,868   | 17,160  |
| 개인   | 31,783  | 31,004  | 779     | 6,392   | 8,798   |
| 외국인  | 187,772 | 227,173 | -39,401 | -43,469 | 24,756  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

| 종목     | 주가/금리    | 전일비    |
|--------|----------|--------|
| KOSPI  | 2,330.84 | -13.07 |
| 국고채3Y  | 0.917    | 0.009  |
| 국고채10Y | 1.503    | 0.021  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

| 만기     | Mid    | 전일비    |
|--------|--------|--------|
| CDS 5Y | 25.472 | -0.047 |

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

| 종목     | 순매수    | 5일 누적  | 20일누적  |
|--------|--------|--------|--------|
| KOSPI  | 1,046  | -983   | 7,058  |
| KOSDAQ | 2,371  | 2,195  | 2,411  |
| 국고채    | -1,186 | -2,702 | 9,625  |
| 통안채    | -307   | 3,675  | 28,118 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

| Korea | 종가    | 전일비    | US Libor | 종가      | 전일비      |
|-------|-------|--------|----------|---------|----------|
| 기준    | 0.500 | 0.000  | 1M       | 0.14463 | -0.00687 |
| Call  | 0.460 | -0.020 | 3M       | 0.21325 | -0.00900 |
| CD    | 0.630 | 0.000  | 6M       | 0.24650 | 0.00025  |
| 통안1년  | 0.700 | 0.006  | 12M      | 0.33175 | -0.00025 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

| 종목         | 종가        | 전일비     | 전일비(%) | 1주(%) |
|------------|-----------|---------|--------|-------|
| 다우지수       | 27,463.19 | -222.19 | -0.80  | -2.99 |
| S&P        | 3,390.68  | -10.29  | -0.30  | -1.52 |
| 나스닥        | 11,431.35 | 72.41   | 0.64   | -0.74 |
| FTSE 100   | 5,728.99  | -63.02  | -1.09  | -2.72 |
| DAX 30     | 12,063.57 | -113.61 | -0.93  | -5.29 |
| Nikkei 225 | 23,485.80 | -8.54   | -0.04  | -0.34 |
| Shanghai   | 3,254.32  | 3.20    | 0.10   | -2.22 |
| 항셍 H       | 10,003.10 | -122.49 | -1.21  | 0.25  |
| 미국채 2년     | 0.15      | 0.00    | -2.74  | 1.54  |
| 미국채 10년    | 0.77      | -0.03   | -4.17  | -2.30 |
| WTI        | 39.57     | 1.01    | 2.62   | -4.56 |
| Gold       | 1,908.71  | 6.11    | 0.32   | -0.01 |

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

| 만기  | Mid   | 전일비  |
|-----|-------|------|
| 1M  | 0.20  | 0.00 |
| 3M  | 0.05  | 0.05 |
| 6M  | -0.20 | 0.10 |
| 12M | -1.00 | 0.10 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

| 만기 | Mid   | 전일비   |
|----|-------|-------|
| 1Y | 0.160 | 0.005 |
| 2Y | 0.145 | 0.025 |
| 3Y | 0.190 | 0.015 |
| 4Y | 0.220 | 0.015 |
| 5Y | 0.280 | 0.005 |

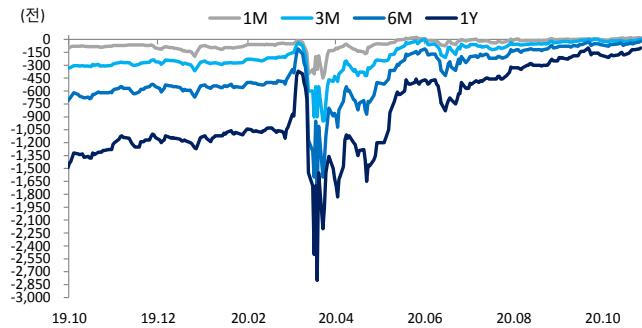
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

| 아시아 통화    |        |         |       |         | 기타 통화    |         |       |         |          |         |       |
|-----------|--------|---------|-------|---------|----------|---------|-------|---------|----------|---------|-------|
| 종목        | 종가     | 전일비     | 1주(%) | 종목      | 종가       | 전일비     | 1주(%) | 종목      | 종가       | 전일비     | 1주(%) |
| USD Index | 92,940 | -0.105  | -0.14 | USD/KRW | 1,125.45 | -2.40   | -1.22 | USD/RUB | 77,290.6 | 0.8471  | -0.09 |
| EUR/USD   | 1.1796 | -0.0014 | -0.22 | USD/CNY | 6.7055   | -0.0067 | 0.43  | USD/BRL | 5.7062   | 0.0815  | 1.79  |
| USD/JPY   | 104.42 | -0.42   | -1.02 | USD/HKD | 7.7501   | 0.0000  | 0.00  | USD/ZAR | 16.2028  | -0.0232 | -1.70 |
| GBP/USD   | 1.3044 | 0.0020  | 0.74  | USD/SGD | 1.3606   | -0.0008 | 0.24  | USD/MXN | 21.0129  | 0.0783  | -0.51 |
| USD/CHF   | 0.9087 | 0.0009  | 0.18  | USD/TWD | 28.728   | -0.025  | -0.28 | USD/PLN | 3.8887   | 0.0118  | 0.74  |
| AUD/USD   | 0.7129 | 0.0006  | 1.15  | USD/INR | 73.72    | -0.13   | 0.33  | USD/TRY | 8.1866   | 0.1006  | 4.08  |
| NZD/USD   | 0.6710 | 0.0032  | 1.96  | USD/IDR | 14,625   | -25     | -0.23 | USD/SEK | 8.7249   | -0.0203 | -0.26 |
| USD/CAD   | 1.3185 | -0.0027 | 0.43  | USD/THB | 31.250   | -0.028  | -0.09 | USD/NOK | 9.1754   | -0.0692 | -1.17 |

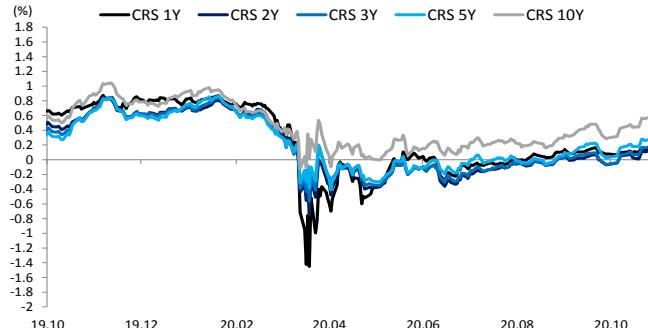
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



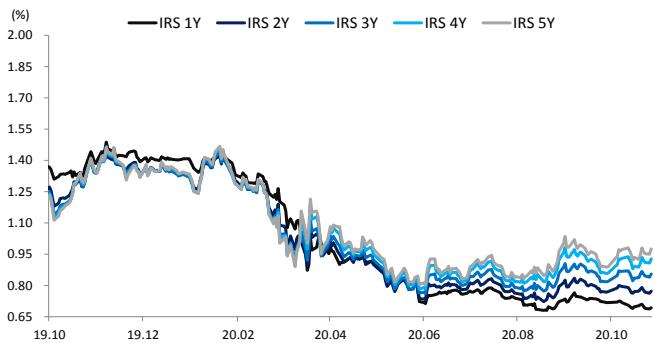
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



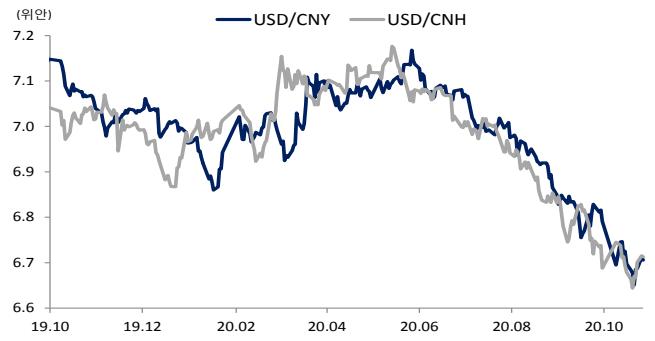
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



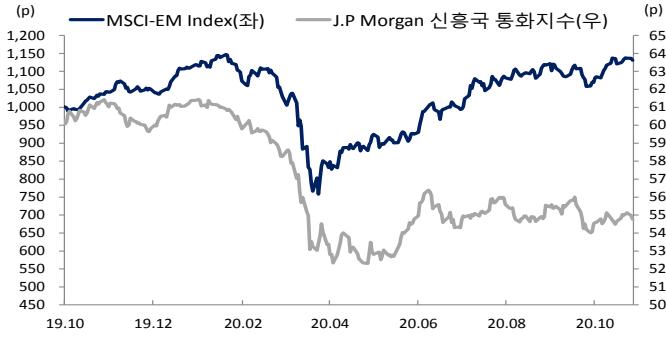
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



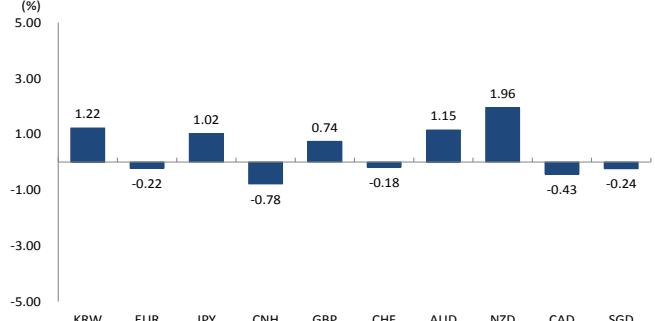
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



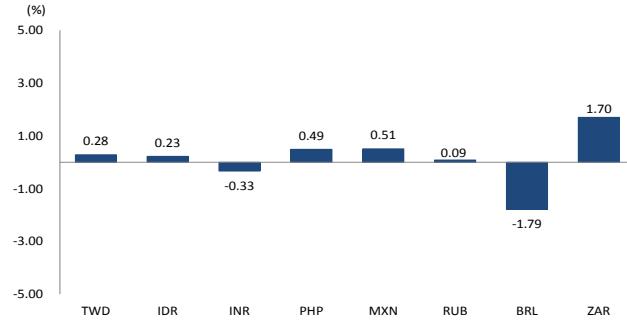
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터