

Daily Forex Live

2023년 10월 6일 금요일

고용지표 대기모드, 연휴 앞두고 수급 공방

금일 달러/원 예상: 1,340~1,352원

NDF 종가: 1,345.00(스왑포인트 -1.95 고려 시 1,346.95원 전일비 -3.55)

시장평균환율(MAR): 1,349.40원

금일 전망: 제한적 하락 압력에 레인지 장세 예상**상승요인:** 커스터디 매수, 실수요 수입업체 결제물량 유입**하락요인:** 유가하락에 따른 미 국채금리 진정, 달러인덱스 하락

미 국채금리 상승과 고용시장의 냉각 등을 우려한 메리 데일리 샌프란시스코 연은 총재의 추가 금리인상에 대한 부정적인 발언에 미 국채금리가 안정되는 모습을 보이면서 유가 안정과 달러/원 환율 하락을 견인함. 이는 견고하였던 미 고용시장의 균열 예상과 함께 달러하락 압력으로 작용하여 달러/원은 숨 고르기 돌입 예상.

다만, 수입업체 결제를 비롯한 달러 실수요 주체 매수 유입과 외국인 순매도, 아직 완전히 해결되지 않은 미 셰다운 정치적 리스크 등은 하단에서 환율 하락을 상쇄할 것. 오늘 달러/원 하락 출발 후, 추가적인 하락 압력이 우위를 보이겠으나 오늘 발표될 고용지표를 기다리며 수급에 의한 레인지 장세 보일 것으로 예상.

전일 동향: 달러 약세 흐름에 하락하였으나 낙폭 되돌리며 마감

전일 달러/원은 1,350.50(-13.0)원. 전일 종가 대비 10.5원 하락한 1,353원으로 출발한 환율은 美 국채수익률 하락폭과 연동하여 역외 롱스탑 물량 출회하며 1,345원 하향 돌파를 시도하였으나 대기중인 저가 결제 수요 물량 유입에 따라 지지. 이후 레인지 장세 흐름 지속되며 1,350원대에서장을 마감.

글로벌 동향: 달러화, 美 고용보고서 발표 대기에 따라 하락 마감

달러지수: 106.332(-0.467), 유로/달러 1.0550(+0.0046), 달러/엔 148.51(-0.15)

달러화는 비농업 부문 신규 고용 등 고용보고서 발표를 앞두고 소폭 하락 마감. 미국 주간 신규 실업수당 청구건수는 전주보다 2천명 증가한 20.7만명으로 집계되어 예상치 21만 명을 하회. 9월 미국 기업들의 감원 계획은 전달보다 감소했으나, 올해 전체 감원 계획은 2020년 이후 최대 기록하며 실업률 반영 예상.

엔화는 일본 외환 당국자들의 지속적인 구두 개입 및 BOJ의 환시 개입 경계감 유지에 따라 소폭 상승 마감하며 추가 약세 제한. 국제유가는 한때 5% 이상 하락하며 배럴당 82.31달러로 마감. 이는 미국 국채금리의 가파른 상승세를 진정시키는 재료로 소화되며 10년물 국채금리는 약 3bp 하락.

유로화는 9월 서비스업 구매관리자수(PMI) 확정치가 48.7을 기록하며 예비치 48.4와 전월 수치 47.9를 모두 상회. 독일 8월 무역수지도 166억 유로 흑자를 기록하며 전망치 161억 유로를 상회. 이에 유로존의 경제 지표가 기준 전망보다 나쁘지 않았다는 점에 주목하며 소폭 상승 마감.

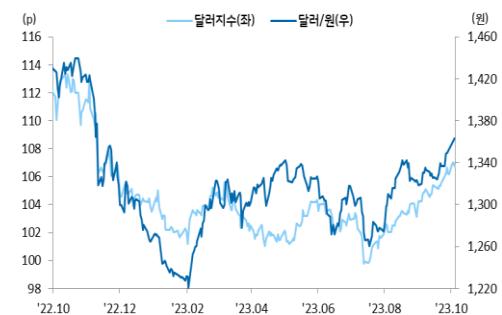
FX Economist 민경원

eco_min1230@wooribank.com

NDF 최종호가	저가	고가
1,350.90/1,351.10	-	-

오늘 외환시장 주요 이벤트

- 15:00 독일 8월 제조업 주문 MoM(예상 1.5%, 이전 -11.7%)
- 21:30 유로 클라스 노트 네덜란드 중앙은행 총재 연설
- 21:30 미국 9월 비농업 신규고용(예상 170k, 이전 187k)
- 21:30 미국 9월 실업률(예상 3.7%, 이전 3.8%)
- 21:30 미국 9월 시간당 평균 임금상승 MoM(예상 0.3%, 이전 0.2%)
- 01:00 미국 크리스토퍼 월러 연준 이사 연설

달러/원, 달러지수(vs G10)**달러/원 1, 2개월 리버설****미국 국채금리 유가 하락과 고용 부진에 하락, 달러지수 하락**

출처: 연합인포맥스, Bloomberg, 우리은행 트레이딩부

전일 SPOT 종가

(단위: 원, 억달러)

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비
USD/KRW	1,350.50	(13.00)	1,353.00	1,353.70	1,345.40	8.30	115.79	(4.34)
JPY/KRW	908.00	(5.38)	915.20	915.20	906.22	8.98	-	-
EUR/KRW	1,420.01	(5.42)	1,432.60	1,432.60	1,416.20	16.40	-	-
CNH/KRW	184.55	(1.52)	186.24	186.24	184.10	2.14	-	-

출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부

주요통화 환율

아시아/신흥국 통화 환율

FX SWAP POINT

(단위: 원)

종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	만기	Mid	전일비
USD Index	106.332	(0.467)	0.10	USD/KRW	1,350.50	(13.00)	0.09	1M	(2.00)	0.10
EUR/USD	1.0550	0.0046	(0.15)	USD/SGD	1.3670	(0.0051)	0.09	2M	(4.10)	0.25
USD/JPY	148.51	(0.61)	(0.54)	USD/IDR	15615	(17)	-	3M	(7.20)	0.35
GBP/USD	1.2192	0.0057	(0.09)	USD/PHP	56.68	(0.03)	(0.52)	6M	(14.70)	0.40
USD/CNH	7.3064	(0.0100)	0.16	USD/RUB	100.0562	0.0365	3.35	12M	(29.10)	1.00
USD/CHF	0.9123	(0.0049)	(0.30)	USD/ZAR	19.5176	0.1843	2.82			
AUD/USD	0.6370	0.0045	(0.89)	USD/MXN	18.2613	0.3058	4.11			
NZD/USD	0.5966	0.0053	0.07	USD/PLN	4.3626	(0.0209)	(0.64)			
USD/CAD	1.3705	(0.0040)	1.62	USD/TRY	27.5522	(0.0163)	0.55			

출처: 블룸버그, 우리은행 트레이딩부 / 주: 뉴욕시장 종가 기준(한국시간 06:00)

IRS(vs 3M CD)

(단위: %, bp)

만기	Offer	Bid	Mid	전일비
1Y	4.045	4.015	4.030	(7.50)
2Y	4.075	4.040	4.058	(7.00)
3Y	4.075	4.045	4.060	(5.75)
4Y	4.090	4.060	4.075	(5.00)
5Y	4.090	4.060	4.075	(6.50)

한국/미국(SOFR) 단기금리

(단위: %, bp)

한국	종가	전일비	미국	종가	전일비
기준	3.50	0.00	기준	5.50	0.00
RP(7일)	3.93	1.00	1M	5.3360	0.56
CD	3.83	(1.00)	3M	5.4062	(1.62)
통안3M	3.657	0.00	6M	5.4626	(3.07)
통안1Y	3.773	0.10	12M	5.4298	(5.39)

CRS(vs 3M SOFR)

(단위: %, bp)

만기	Offer	Bid	Mid	전일비
1Y	3.424	2.976	3.200	(5.50)
2Y	3.474	2.986	3.230	(5.50)
3Y	3.518	3.022	3.270	(5.00)
4Y	3.518	3.042	3.280	(5.50)
5Y	3.575	3.095	3.335	(5.50)

국내시장 동향

(단위: p, %, bp)

종목	주가/금리	전일비	종목	외인 순매수	5일누적
KOSPI	2,403.60	(2.09)	KOSPI	(2,711)	(8,902)
KOSDAQ	801.02	(6.38)	KOSDAQ	763	(3,978)
국고채3Y	4.081	(2.70)	국고채	1,552	12,094
국고채10Y	4.322	(2.90)	통안채	0	2,095

출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부

글로벌 금융시장

(단위: p, %, bp, 달러, 달러/톤)

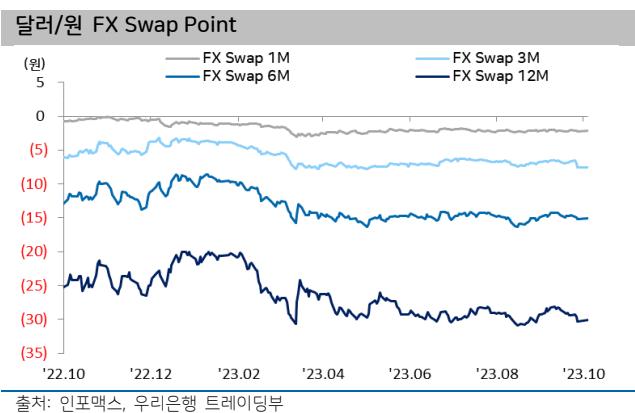
종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)	종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
Dow Jones	33,119.57	(9.98)	(0.03)	(1.62)	미국채 2Y	5.0183	(3.35)	(0.66)	(0.79)
S&P	4,258.19	(5.56)	(0.13)	(0.97)	미국채 10Y	4.7185	(1.44)	(0.30)	3.14
NASDAQ	13,219.83	(16.18)	(0.12)	0.14	WTI	82.31	(1.91)	(2.27)	(10.25)
EuroStoxx 50	4,099.81	(0.04)	0.00	(1.48)	Brent	84.07	(1.74)	(2.03)	(11.86)
DAX 30	15,070.22	(29.70)	(0.20)	(1.65)	구리	7,899.00	(50.50)	(0.64)	(3.88)
Nikkei225	31,075.36	548.48	1.80	(2.50)	니켈	18,490.00	(233.00)	(1.24)	(2.10)
Shanghai	휴장	-	-	-	대우	1,280.75	7.75	0.61	(1.52)
Hang Seng H	5,887.98	5.30	0.09	(1.71)	Gold	1,816.60	(1.90)	(0.10)	(2.35)

출처: 인포맥스, Bloomberg, 우리은행 트레이딩부

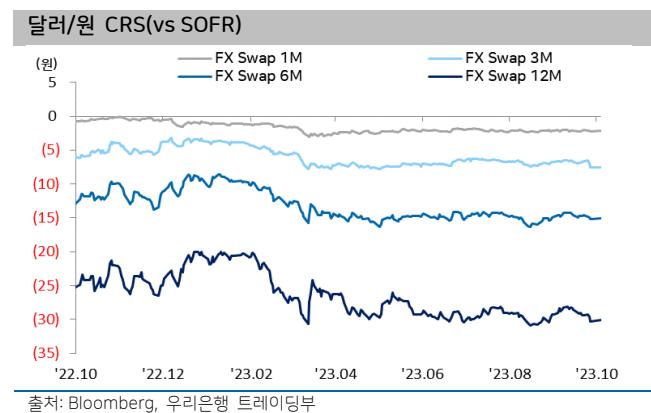
경제지표 및 이벤트

전일	금일	익일
08:00 한국 9월 CPI YoY(예상 3.5%, 이전 3.4%)	15:00 독일 8월 제조업 주문 MoM(예상 1.5%, 이전 -11.7%)	15:00 독일 8월 산업생산 MoM(예상 -, 이전 -0.8%)
17:00 유로 피터 카지미르 슬로바키아 중앙은행 총재 연설	21:30 유로 클라스 노트 네덜란드 중앙은행 총재 연설	17:30 유로 10월 센티ックス 투자자기대(예상 -, 이전 -21.5%)
21:30 미국 8월 무역수지(예상 -\$59b, 이전 -\$65.0b)	21:30 미국 비농업 신규고용(예상 170k, 이전 187k)	22:00 미국 로리 로건 댈러스 연은 총재 연설
21:30 미국 주간 신규 실업수당청구(예상 210k, 이전 204k)	21:30 미국 9월 실업률(예상 3.7%, 이전 3.8%)	01:50 미국 필립 제퍼슨 연준 부의장 연설
22:00 미국 로레타 메스터 글리블랜드 연은 총재 연설	21:30 미국 9월 시간당 평균 임금상승 MoM(예상 0.3%, 이전 0.2%)	
22:00 유로 요아힘 나겔 독일 중앙은행 총재 연설	01:00 미국 크리스토퍼 월리 연준 이사 연설	
23:30 유로 빌누아 드 갈로 프랑스 중앙은행 총재 연설		
23:40 미국 낸 카시카리 미니애폴리스 연은 총재 연설		
00:30 미국 토마스 바킨 리치먼드 연은 총재 연설		
01:00 미국 메리 데일리 샌프란시스코 연은 총재 연설		

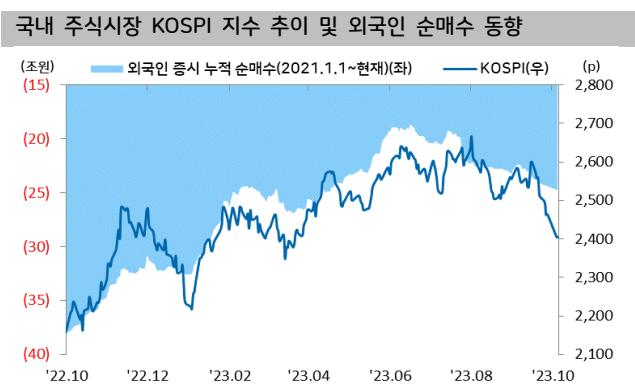
Chart



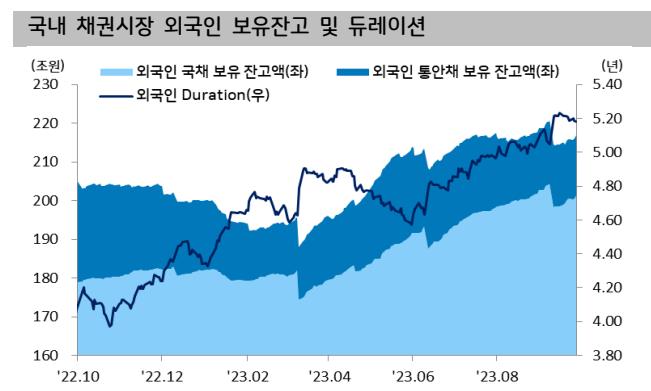
출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부



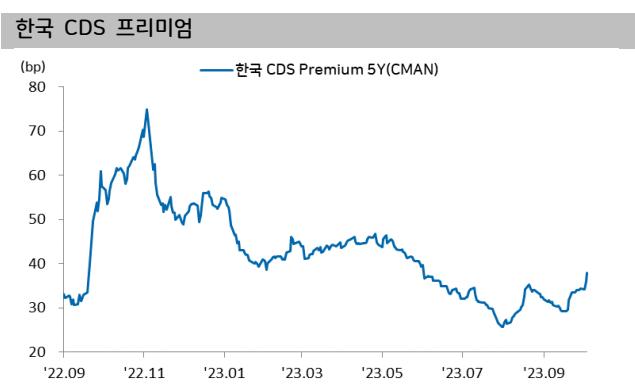
출처: Bloomberg, 우리은행 트레이딩부



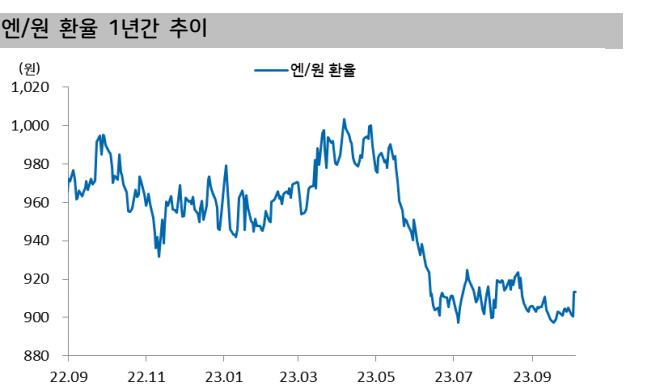
출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부



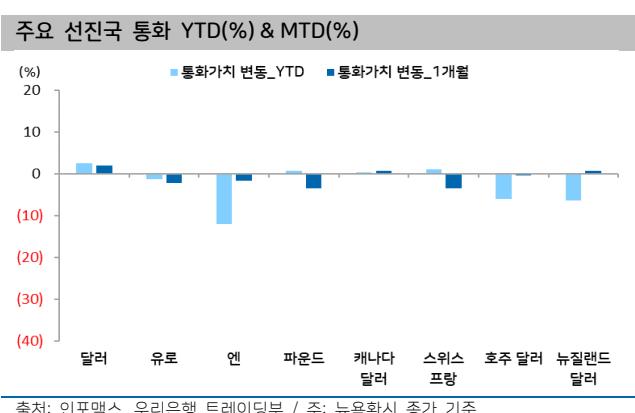
출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부



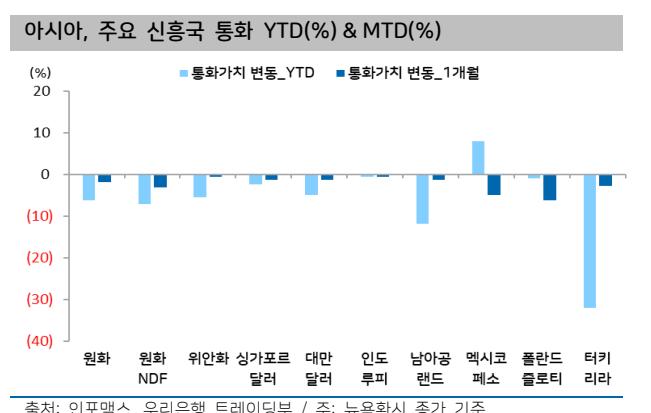
처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부



출처: Bloomberg, 우리은행 트레이딩부



출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부 / 주: 뉴욕환시 종가 기준



출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부 / 주: 뉴욕환시 종가 기준

Compliance Notice

본 자료에 기재된 내용들은 작성자 본인의 의견을 정확하게 반영하고 있으며 외부의 부당한 압력이나 간섭 없이 작성되었음을 확인합니다(작성자: 민경원).

본 자료는 고객의 투자를 돋기 위한 목적으로 작성되었습니다. 본 자료에 수록된 내용은 당행이 신뢰할 만한 자료 및 정보를 바탕으로 작성한 것이나, 당행이 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없으므로 참고 자료로만 활용하시기 바라며 투자 시 투자자 자신의 판단과 책임하에 최종 결정을 하시길 바랍니다. 따라서 본 자료는 어떠한 경우에도 고객의 투자 결과에 대한 법적 책임 소재의 증빙자료로 사용될 수 없으며 직간접적 손실이 발생해도 당행은 책임을 지지 않습니다.

본 자료는 자본시장법 상 조사분석자료가 아니며 조사분석의 독립성을 확보하기 위한 법적 제한을 받지 않습니다. 또한 법령 상 허용되는 범위 내에서 당행이 본 자료에 언급된 통화 및 관련 금융상품 등을 거래하거나 관련 금융서비스를 제공할 수 있으며 이와 관련해 당행이 이해관계를 가질 수 있습니다.

본 자료에 기재된 의견은 예측에 불과하며 별도 통지 없이 변경될 수 있고 일정한 주기로 업데이트 되지 않을 수 있습니다.

본 자료는 어떠한 경우에도 당행의 사전동의 없이 복사, 인용, 배포, 전송, 대여 및 변경될 수 없습니다