

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

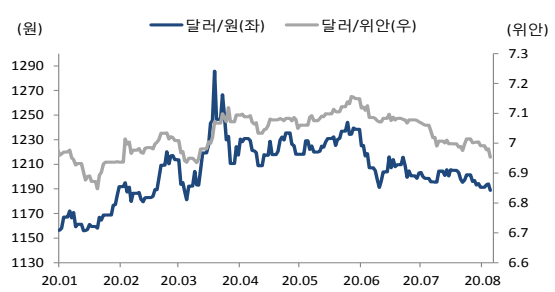
◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD008	1188.50	▼5.5	4.8	720,627
USD009	1188.70	▼5.2	4.8	15,583
USD/KRW	1188.80	▼5.3	5	
USD/CNY	6.9533	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	92.820	▼0.5620	UST2Y	0.1171
EUR/USD	1.1863	▲0.0060	UST10Y	0.5477
USD/JPY	105.60	▼0.1200	UST30Y	1.2217
GBP/USD	1.3114	▲0.0043	WTI	42.19

차트1. 달러/위안 & 달러/원



출처: 인포팩스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/인덱스 & 달러/원



출처: 인포팩스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(08/05)	금 일(08/06)	익 일(08/07)
16:55 독일 7월 마켓 종합 PMI(F)(결과:57.3, 잠정:55.5)	15:00 영국 BOE 통화정책회의 기준금리결정(예상:동결)	15:00 독일 6월 산업생산 MoM(예상:3.0%, 이전:7.8%)
17:00 유럽 7월 마켓 종합 PMI(F)(결과:54.9, 잠정:54.8)	15:00 독일 6월 제조업주주 MoM(예상:10.0%, 이전:10.4%)	15:45 프랑스 6월 산업생산 MoM(예상:3.4%, 이전:19.6%)
21:15 미국 7월 ADP비농업부문 고용자수(결과:167k, 이전:4314k)	21:30 미국 주간 신규 실업수당 청구(예상:1414k, 이전:1434k)	21:30 미국 7월 비농업부문 고용자수 변동(예상:1500k, 이전:4800k)
23:00 미국 7월 ISM서비스지수(결과:58.1, 이전:57.1)	21:30 미국 실업보험 연속수급 신청(예상:16900k, 이전:17018k)	21:30 미국 7월 실업률(예상:10.5%, 이전:11.1%)
(08/06)	23:00 미국 Fed 로버트 카플란(달러스, 투표권)총재 연설	23:00 미국 7월 도매재고 MoM(F)(예상:-2.0%, 잠정:-2.0%)
06:00 미국 Fed 로레타 메스터(클리브랜드,투표권)총재 연설		N/A 중국 7월 수출 YoY(예상:-0.6%, 이전:0.5%)
		N/A 중국 7월 수입 YoY(예상:1.0%, 이전:2.7%)

\*주: 예상 대비 호조(상승), 예상치 부합, 예상 대비 부진(하락), Bloomberg 컨센서스 기준

약달러 모멘텀 지속

금일 달러/원 예상 : 1,182.00~1,189.00

NDF 최종호가 : 1,186.40/1,186.70(-2.15)

야간달러선물 증가 : 1,185.90원 | 고가:1,187.90원 | 저가:1,183.80원

전일 국내 동향

달러/원은 전일대비 2.1원 하락한 1,192원에 개장. 개장 초 1,193원에 고점을 형성한 뒤 증시 상승과 역외 위안화 강세의 영향에 하락폭을 키움. 이후 별다른 방향성 없이 1,180원 후반대에서 박스권 등락을 보이던 환율은 전일대비 5.3원 하락한 1,188원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 부진한 고용지표 발표에 미국 경기회복에 우려가 부각되며 하락. 이날 발표된 경기지표는 대체로 양호. 7월 ISM 서비스지수는 58.1로 시장예측(55.0)을 상회하며 19년 초 이후 최고치를 기록. 미국 7월 마켓 서비스PMI 또한 시장 예측을 상회. 다만 7월 비농업부문 취업자수가 예상치(120만 명 증가)를 크게 하회하는 16.7만 명 증가에 그쳐 고용회복 쇼크의 우려를 키움.

추가 부양안 논의는 진전을 보이며 합의 타결에 대한 기대 증가. 그간 쟁점이었던 실업수당 부분에서 백악관이 주당 400달러 선 까지 양보하는 등 일부 사안에서 양보가 이루어짐. 양당은 금주 합의를 목표로 재협상에 돌입. 이에 투자 심리가 개선되어 미 증시는 상승. 다우지수는 1.39% 상승. 나스닥 지수는 장중 11,000선을 돌파하기도 하며 0.53% 상승.

유로화는 약달러 기조에 상승세를 지속. 엔화는 미국 추가 부양안 협의 난항에 따른 안전통화 수요와 미일 금리차가 축소 영향에 강세. 국제유가는 2주 연속 급감한 미국 내 원유재고 발표에 강세 마감.

금일 전망

금일 달러/원은 미국 비농업부문 고용 부진 우려가 촉발한 약달러 흐름의 영향에 하락세가 우위를 보일 것으로 전망. 달러 지수는 약세 우위 속 92선에 진입.

또한 전일 미국 추가 부양안 협의 기대가 살아나며 미 증시가 상승한 점은 아시아 주요 증시 상승을 촉발할 수 있으며 이는 아시아 주요통화와 원화 강세에 우호적 재료. 전일 코스피 지수가 연고점을 경신한데 이어 추가 상승을 이어간다면 이는 달러/원 하방 압력을 가중할 것. 역외 위안의 강세 흐름 또한 달러/원에 하락 압력을 가중. 역외 위안은 간밤 꾸준히 레벨을 낮춰 6.94 수준까지 근접.

다만 금주들어 국내 증시에서 여전히 순매도 우위를 나타내는 외국인의 수급 동향은 환율의 하단을 제한 가능한 요인. 또한 소셜 미디어 앱을 둘러싼 미중간 갈등이 완전히 해소된 상태가 아닌점은 잠재적 지정학적 리스크로 작용. 미국이 대만과 단교이후 40년 만에 최고위급 인사인 미 보건장관이 방문할 것을 알리자 중국이 즉각 반발. 1,180원 레벨까지 낮아진 상황에서 추가 하락 시도시 결제수요와 저가매수 수요가 적극 매수 대응할 가능성 또한 존재.

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD008	1,188.50	-5.50	1,192.30	1,193.00	1,188.20	4.80	251,723	77,469	720,627	1,855
USD009	1,188.70	-5.20	1,192.40	1,192.90	1,188.10	4.80	3,656	1,121	15,583	1,708
USD SPOT	1,188.80	-5.30	1,192.00	1,193.00	1,188.00	5.00	6,762	1,944	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	63,538	61,909	1,629	-28,540	-28,808
은행	3,794	516	3,278	-9,780	31,897
투신	39	1,934	-1,895	-13,619	-33,432
보험	54	155	-101	4,916	1,318
기타법인	8,961	4,825	4,136	6,123	4,672
개인	42,940	27,125	15,815	9,773	3,386
외국인	136,497	159,359	-22,862	31,127	20,181

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	증가/금리	전일비
KOSPI	2,311.86	31.89
국고채3Y	0.795	-0.007
국고채10Y	1.293	-0.013

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	23.481	0.164

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-516	-2,096	18,207
KOSDAQ	1,347	134	448
국고채	702	7,183	29,864
통안채	3,002	686	26,791

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.15350	0.00425
Call	0.460	-0.010	3M	0.24200	-0.00650
CD	0.760	0.000	6M	0.29838	-0.00712
통안1년	0.592	-0.006	12M	0.44350	-0.00738

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,201.52	373.05	1.39	2.49
S&P	3,327.77	21.26	0.64	2.13
나스닥	10,998.40	57.23	0.52	4.32
FTSE 100	6,104.72	68.72	1.14	-0.44
DAX 30	12,660.25	59.38	0.47	-1.26
Nikkei 225	22,514.85	-58.81	-0.26	0.53
Shanghai	3,377.57	5.88	0.17	2.52
항생 H	10,256.64	52.76	0.52	0.71
미국채 2년	0.12	0.01	9.13	-10.54
미국채 10년	0.55	0.04	8.05	-4.60
WTI	42.19	0.49	1.18	2.23
Gold	2,032.12	32.45	1.62	3.66

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	-0.10	-0.15
3M	-0.65	-0.10
6M	-1.40	-0.20
12M	-3.40	-0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	-0.005	-0.005
2Y	-0.060	0.000
3Y	-0.050	0.000
4Y	-0.045	0.015
5Y	-0.035	0.020

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

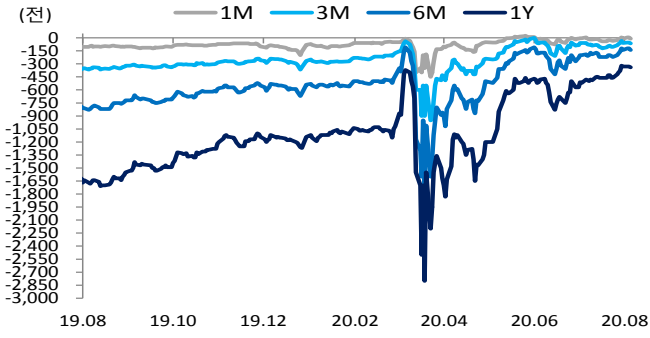
아시아 통화

기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	92.820	-0.562	-0.68	USD/KRW	1,188.75	-5.30	-0.36	USD/RUB	72.8864	-0.6535	0.42
EUR/USD	1.1863	0.0060	0.60	USD/CNY	6.9366	-0.0368	-0.93	USD/BRL	5.2936	0.0071	2.40
USD/JPY	105.60	-0.12	0.65	USD/HKD	7.7501	0.0001	0.00	USD/ZAR	17.3242	-0.0600	4.73
GBP/USD	1.3114	0.0043	0.90	USD/SGD	1.3698	-0.0034	-0.28	USD/MXN	22.3728	-0.2973	1.82
USD/CHF	0.9085	-0.0048	-0.45	USD/TWD	29.425	-0.049	0.14	USD/PLN	3.7127	-0.0118	-0.63
AUD/USD	0.7192	0.0032	0.06	USD/INR	74.94	-0.10	0.19	USD/TRY	7.0477	0.1503	0.99
NZD/USD	0.6647	0.0025	-0.33	USD/IDR	14,550	-75	0.05	USD/SEK	8.6794	-0.0399	-0.49
USD/CAD	1.3266	-0.0053	-0.55	USD/THB	30.995	-0.095	-1.43	USD/NOK	8.9516	-0.1650	-0.85

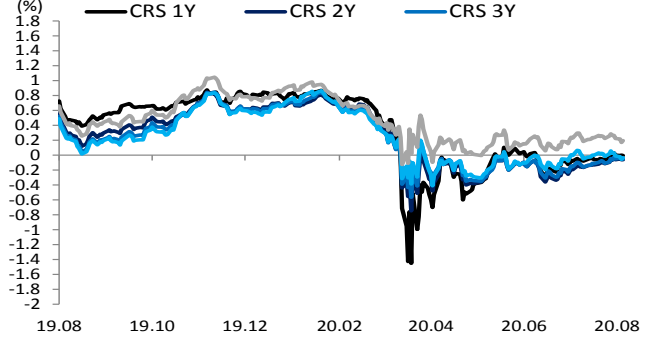
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



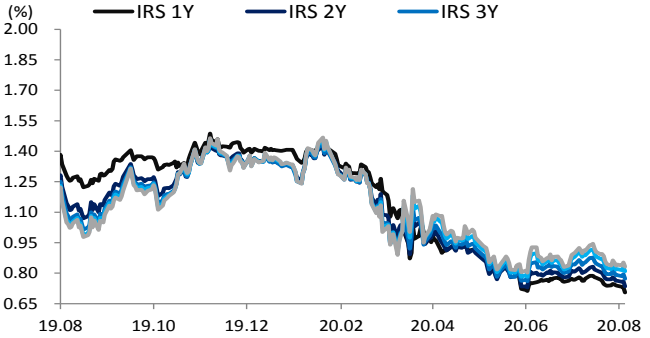
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



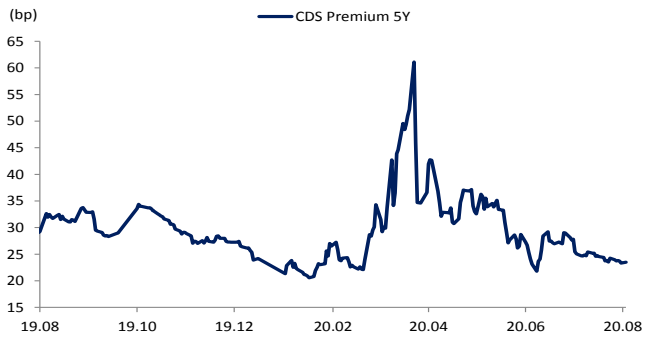
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



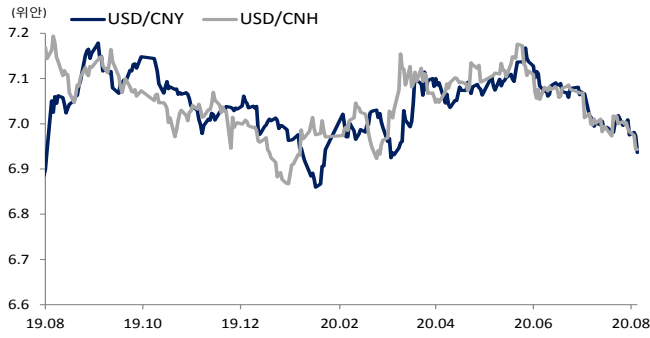
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



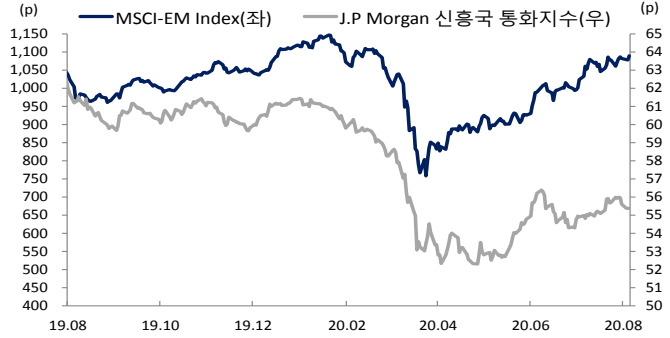
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



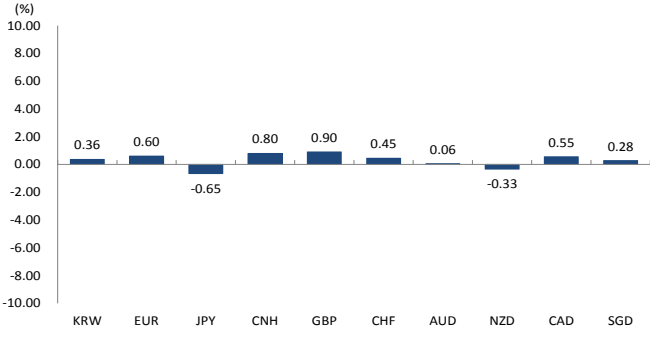
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



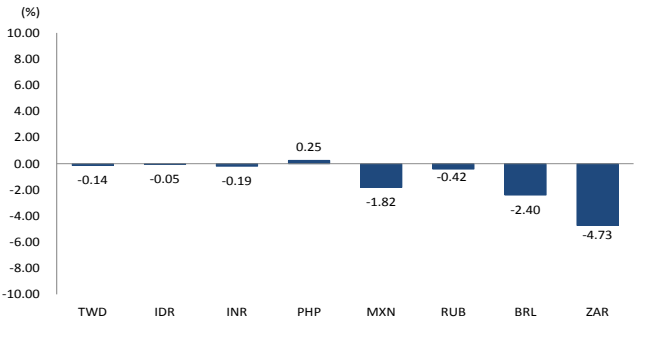
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

본 자료는 투자의 이해를 돕기 위해 참고가 되는 정보 제공을 목적으로 작성되었습니다. 당사 고객들에게 배포되는 자료로서 본 조사자료의 내용은 당사의 리서치센터에서 신뢰할 수 있는 자료와 정보를 이용하여 작성한 것이나, 당사는 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없습니다. 투자자는 자신의 판단과 책임하에 투자를 하여야 하며, 본 자료는 투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙자료로 사용될 수 없습니다. 그리고 파생상품은 높은 가격변동성으로 인해 단기간에 투자원금의 전부 또는 상당부분을 손실할 수 있습니다. 본 자료는 당사 홈페이지(www.futures.co.kr)에서도 이용하실 수 있습니다.