

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

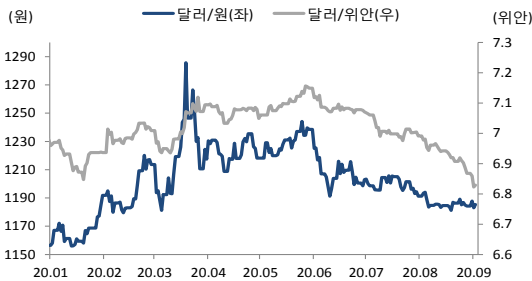
◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD009	1185.90	▲2.3	3.1	749,148
USD010	1185.60	▲2.3	3.0	11,871
USD/KRW	1185.40	▲2.4	2.8	
USD/CNY	6.8291	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	92.644	▲0.3060	UST2Y	0.1329
EUR/USD	1.1855	▼0.0057	UST10Y	0.6477
USD/JPY	106.18	▲0.2200	UST30Y	1.3788
GBP/USD	1.3350	▼0.0034	WTI	41.51

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포팩스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포팩스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/02)	금 일(09/03)	익 일(09/04)
21:15 미국 8월 ADP취업자 변동(결과:428k, 이전:212k)	07:00 미국 Fed 메리 테일러(샌프란시스코, 투표권) 연설	10:30 호주 7월 소매판매 MoM(예상:3.3%, 이전:2.7%)
23:00 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권) 연설	10:45 중국 8월 차이신 종합 PMI(예상:-, 이전:54.5)	15:00 독일 7월 제조업주 MoM(예상:5.0%, 이전:27.9%)
23:30 미국 DOE 주간 원유재고(결과:-9362k, 이전:-4689k)	16:50 프랑스 8월 마켓 종합 PMI(F)(예상:51.7, 잠정:51.7)	17:30 영국 8월 마켓 건설 PMI(예상:58.3, 이전:58.1)
(09/03)	16:55 독일 8월 마켓 종합 PMI(F)(예상:53.7, 잠정:53.7)	21:30 미국 8월 비농업부문 고용자수 변동(예상:1390k, 이전:1763k)
02:00 독일 연스 바이트만 분데스뱅크 총재 연설	21:30 미국 주간 신규실업수당 청구(예상:950k, 이전:1006k)	21:30 미국 8월 실업률(예상:9.8%, 이전:10.2%)
03:00 미국 Fed 베이직북 공개	22:45 미국 8월 마켓 종합 PMI(F)(예상:-, 잠정:54.7)	
04:00 미국 Fed 닐 카시카리(미니애폴리스, 투표권) 연설	23:00 미국 8월 ISM 비제조업지수(예상:57.0, 이전:58.1)	

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

백신 기대와 지표 호조 속 반등

금일 달러/원 예상 : 1,186.00~1,193.00

NDF 최종호가 : 1,189.40/1,189.80(+4.20)

야간달러선물 증가 : 1,189.50원 | 고가:1,190.60원 | 저가:1,186.10원

전일 국내 동향

전일대비 2원 하락한 1,185원에 개장한 달러/원은 역외 위안과 증시 흐름에 연동하여 소폭 상승. 개장직후 1,184.6원에 저점을 형성했으나 오전 중 아시아 주요 통화 약세와 코스피 낙폭 확대에 상승폭 키움. 이후 1,185원을 중심으로 좁은 폭 등락하다 전일대비 2.4원 상승한 1,185.4원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 경제지표 호조와 코로나19 백신 기대 속 상승. 이날 발표된 ADP 민간고용은 42.8만명 증가하여 예상치(100만)를 하회. 이는 고용불안 우려를 자극했으나 미국 7월 제조업주(6.4%)와 내구재주문(11.4%)이 시장 예상을 뛰어넘자 경기회복 둔화 우려가 완화.

백신 조기보급에 대한 기대 또한 고조. 미 질병통제센터가 주요도시에 이르면 10월 말 백신 보급을 준비시킨 것으로 알려졌으며 파우치 국립알레르기 전염병연구소장은 임상 결과에 따라 백신 조기승인을 결정할 수 있다 밝힘. 이는 미 증시에도 호재로 작용. 다우지수는 1.59% 상승했고 나스닥지수는 0.98% 상승하여 사상 처음으로 12,000pt를 돌파.

유로화는 전일 ECB의 구두개입과 달러 강세 지속 영향에 하락 압력이 가중. 엔화는 아베 총리의 정책을 대부분 계승할 것으로 알려진 스가 관방장관이 차기 총리로 사실상 확정되자 아베노믹스 불확실성이 해소되면서 약세를 보임.

금일 전망

금일 달러/원은 지표호조 속 달러화 강세 지속 영향에 상승 압력이 우세할 것으로 전망. 전일 미 연준은 베이직북을 통해 경기 회복속도 둔화를 언급했으나 견고한 지표 발표에 달러화는 상승을 지속. 국내증시에서 MSCI 리밸런싱 이후 지속적인 순매도세를 보이고 있는 외국인 수급 또한 환율 상승에 영향을 줄 수 있음. 외인들은 금주들어 약 2조원을 순매도. 여전히 수급상 결제수요가 우위인점도 달러/원 상승에 우호적.

다만 레인지 플레이가 지속될 수 있다는 기대는 상단을 제한 가능한 요인. 박스권을 이탈한 1,190원 회복 시도 시 단기 고점 인식에 따른 차익 매물과 이월 네고가 출회될 수 있는 점은 상승폭을 제한. 또한 장중 지표발표에 따른 역외 위안 등 아시아 주요통화 등락과 국내증시 등락에 민감하게 움직이는 만큼 이들에 주목할 필요 있음. 금일 호주 서비스업PMI와 무역수지, 그리고 중국 서비스업PMI 발표가 예정. 이에 금일 달러/원은 글로벌 달러 강세에 상승세가 우세한 가운데 역외 위안과 코스피 흐름을 주시하며 1,190원 레벨 진입 시도를 예상.

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD009	1,185.90	2.30	1,184.70	1,187.60	1,184.50	3.10	201,335	-63,360	749,148	8,038
USD010	1,185.60	2.30	1,184.60	1,187.30	1,184.30	3.00	2,579	-3,604	11,871	429
USD SPOT	1,185.40	2.40	1,185.00	1,187.40	1,184.60	2.80	6,216	-465	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	45,158	58,194	-13,036	-46,330	-57,482
은행	400	300	100	1,262	19,261
투신	224	1,083	-859	-364	17,157
보험	409	797	-388	-4,297	-9,948
기타법인	5,509	7,598	-2,089	692	7,555
개인	16,640	22,990	-6,350	1,381	21,070
외국인	136,080	113,458	22,622	47,696	2,417

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,364.37	14.82
국고채3Y	0.923	-0.054
국고채10Y	1.539	-0.043

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	21.554	-0.099

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-2,560	-23,432	-29,669
KOSDAQ	1,462	2,226	1,740
국고채	4,505	11,386	19,964
통안채	-1,307	927	23,514

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.15475	-0.00088
Call	0.540	0.060	3M	0.25125	0.00012
CD	0.630	0.000	6M	0.28775	-0.01550
통안1년	0.696	-0.016	12M	0.42500	-0.00763

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	29,100.50	454.84	1.59	2.71
S&P	3,580.84	54.19	1.54	2.94
나스닥	12,056.44	116.77	0.98	3.36
FTSE 100	5,940.95	78.90	1.35	-1.59
DAX 30	13,243.43	269.18	2.07	0.40
Nikkei 225	23,247.15	109.08	0.47	-0.19
Shanghai	3,404.80	-5.80	-0.17	2.25
항셍 H	10,000.96	-12.36	-0.12	-2.91
미국채 2년	0.13	0.00	1.53	-11.64
미국채 10년	0.65	-0.02	-3.17	-5.91
WTI	41.51	-1.25	-2.92	-4.33
Gold	1,936.28	-38.78	-1.96	-0.37

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	0.00	0.00
3M	-0.30	0.00
6M	-0.80	0.00
12M	-2.20	-0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.115	-0.025
2Y	0.030	-0.025
3Y	0.050	-0.020
4Y	0.050	-0.020
5Y	0.085	-0.015

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	92.644	0.306	-0.39	USD/KRW	1,185.55	2.45	-0.11	USD/RUB	75.4066	1.8199	0.04
EUR/USD	1.1855	-0.0057	0.21	USD/CNY	6.8383	0.0102	-0.69	USD/BRL	5.3423	-0.0546	-4.80
USD/JPY	106.18	0.22	0.18	USD/HKD	7.7502	0.0002	0.00	USD/ZAR	16.8155	0.1631	-0.35
GBP/USD	1.3350	-0.0034	1.06	USD/SGD	1.3625	0.0011	-0.23	USD/MXN	21.7689	-0.0138	-0.75
USD/CHF	0.9107	0.0013	0.26	USD/TWD	29.433	0.002	-0.01	USD/PLN	3.7234	0.0397	-0.19
AUD/USD	0.7338	-0.0034	1.45	USD/INR	73.03	0.16	-1.71	USD/TRY	7.3872	0.0184	0.26
NZD/USD	0.6772	0.0013	2.28	USD/IDR	14,745	172	0.46	USD/SEK	8.7175	0.0327	-0.01
USD/CAD	1.3045	-0.0019	-0.75	USD/THB	31.220	0.143	-0.45	USD/NOK	8.8387	0.0780	-0.57

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point

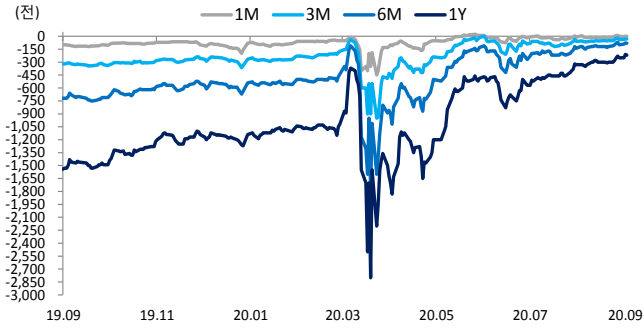


차트. CRS

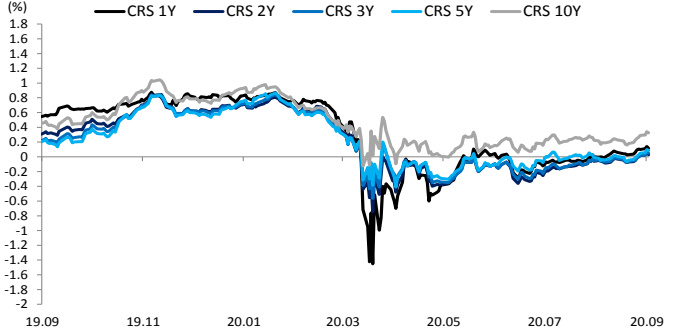


차트. IRS

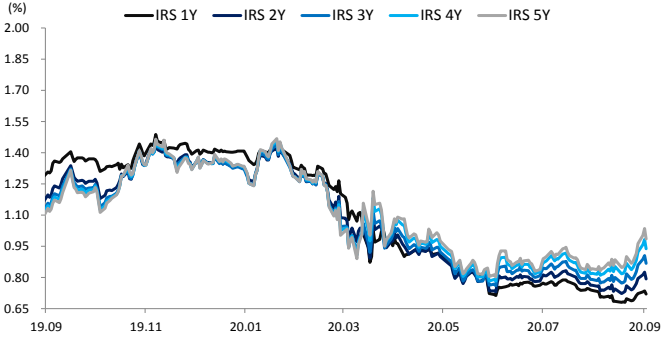


차트. CDS Premium 5Y

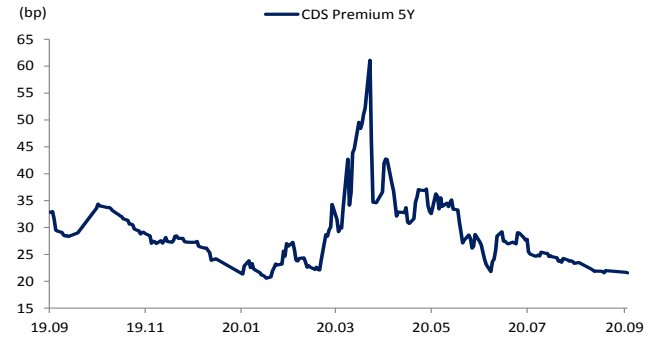


차트. 달러/위안

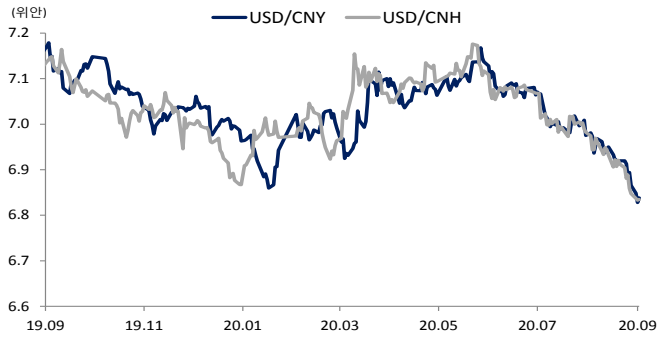


차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수

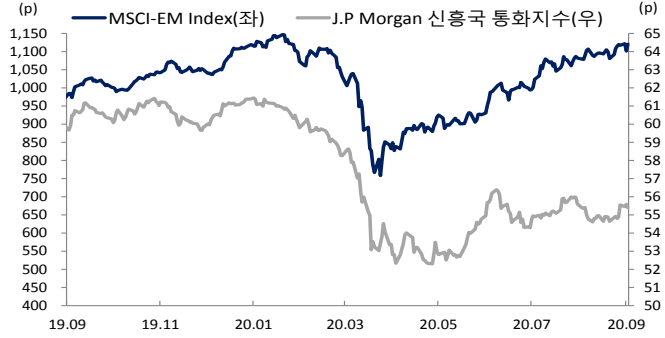


차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율

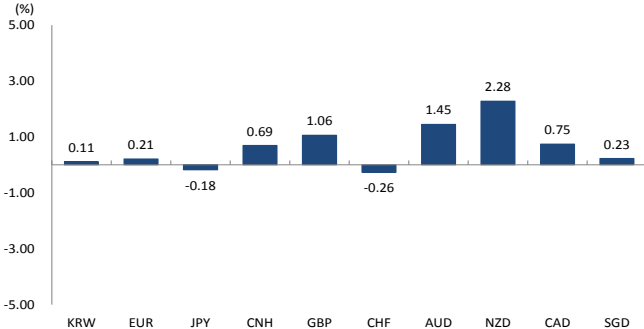


차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율

