

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

기술주 낙폭 확대 속 美 증시 조정

금일 달러/원 예상 : 1,187.00~1,194.00

NDF 최종호가 : 1,190.00/1,190.30(+3.75)

야간달러선물 증가 : 1,190.00원 | 고가:1,190.00원 | 저가:1,188.30원

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD009	1187.50	▼1.3	2.6	736,081
USD010	1187.50	▼1.0	2.5	16,513
USD/KRW	1186.40	▼1.9	2.7	
USD/CNY	6.8323	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.474	▲0.7550	UST2Y	0.1408
EUR/USD	1.1778	▼0.0039	UST10Y	0.6788
USD/JPY	106.03	▼0.2400	UST30Y	1.4213
GBP/USD	1.2982	▼0.0184	WTI	36.84

전일 국내 동향

달러/원은 전일대비 1.3원 하락한 1,187원에 개장. 전일 뉴욕시장 휴장 속 유럽증시 강세에 소폭 하락 출발했으나 역외 위안환율 상승과 달러 강세 전환에 상승 전환. 이후 1,180원 후반대에서 횡보했으나 유럽 지표 호조 속 유로화가 가 상승 전환하자 하락폭을 키워 전일대비 1.9원 하락한 1,186.4원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 기술주 투매 지속이 촉발한 미 증시 급락에 안전자산 선호심리가 회복되며 엔화를 제외한 대부분 주요 통화대비 상승. 테슬라는 주요주주의 지분 매도와 S&P500 편입 실패 영향 등에 매물 출회 지속되며 21.06% 하락. 이는 그동안 지수 상승을 견인했던 기술주들에 대한 투심 위축을 촉발하여 시장 전반의 매물 출회에 영향. 다우지수는 -2.25%, 나스닥은 -4.77%를 기록.

노딜 브렉시트에 대한 우려가 이어지며 파운드화가 급락세를 이어간 점 또한 달러화 강세에 일조. 옹커 EU 전 집행위원장은 이날 언론 인터뷰에서 노딜 브렉시트 발생 가능성이 크다고 전망. 유로화는 ECB 통화정책회의를 앞두고 비둘기적 메시지 기대와 유로화 절상에 대한 우려 메시지를 경계하며 약세 마감.

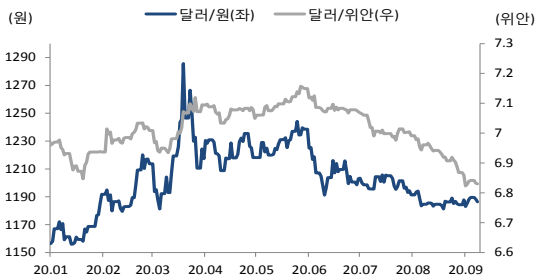
국제유가는 글로벌 수요 둔화 우려 속 사우디가 수출가격 인하를 예고한 영향에 약세. 국제 금가격은 달러 강세 전환에도 안전자산 선호회복에 상승.

금일 전망

금일 달러/원은 강세전환한 달러화 영향과 글로벌 위험자산 조정에 상승 압력 우위 속 1,190원대 회복 시도를 전망. 간밤 뉴욕시장에서는 미 증시의 조정폭이 확대. 그간 지수 상승을 견인해왔던 나스닥 지수가 3 거래일간 10% 이상 하락한 점은 금일 아시아 주요증시와 국내시장의 매물 출회를 자극할 수 있음. 이에 따른 외국인들의 자금 이탈 여부에도 주목. 외국인들은 지난 주 이후 2.6조원의 자금을 순매도. 중국과의 경제 디커플링 발언 등 이어지는 미중 갈등 심화 재료 또한 환율의 상승에 우호적인 재료.

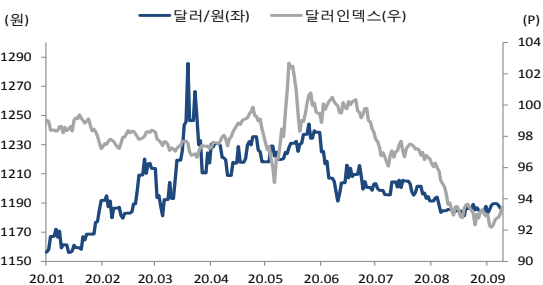
다만 1,190원 상단에서 대기하고 있는 이월 네고 물량은 달러/원의 상단을 제한하는 요인. 최근의 1,190원 진입 시도때 장기간 달러 약세에 외화 예금으로 묶여있던 이월 네고 물량이 출회되는 것을 관측. 수급상 장기간 부재했던 네고물량이 금일 1,190원대에서 적극 대응할 것으로 보임. 이에 달러/원 환율은 글로벌 안전자산 선호 회복과 달러 반등 영향 속 1,190원대 회복시도를 예상하나 네고물량의 저항 속 상승폭은 제한될 것으로 예상.

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/08)	금 일(09/09)	익 일(09/10)
18:00 유럽 2분기 GDP QoQ(F)(결과:-11.8%, 잠정:-12.1%)	08:00 한국 8월 실업률(예상:4.3%, 이전:4.2%)	08:50 일본 7월 핵심기계수주 MoM(예상:2.0%, 이전:-7.6%)
19:00 미국 8월 NFIB 소기업 낙관지수(결과:100.2, 이전:98.8)	09:30 호주 9월 웨스트팩 소비자지대지수(예상:--, 이전:79.5)	20:45 유럽 ECB 통화정책회의 기준금리 결정(예상:동결)
	10:30 중국 8월 PPI YoY(예상:-1.9%, 이전:-2.4%)	21:30 유럽 ECB 라가르드 총재 연설
	10:30 중국 8월 CPI YoY(예상:2.4%, 이전:2.7%)	21:30 미국 8월 PPI YoY(예상:-0.3%, 이전:-0.4%)
	15:00 일본 8월 공작기계수주 YoY(P)(예상:--, 이전:-31.1%)	21:30 미국 주간 신규실업수당 청구건수(예상:845k, 이전:881k)
	20:00 미국 MBA 주택융자 신청지수(예상:--, 이전:-2.0%)	23:00 미국 7월 도매재고 MoM(F)(예상:-0.1%, 잠정:-0.1%)
		24:00 미국 DOE 주간 원유재고(예상:--, 이전:-9362k)

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD009	1,187.50	-1.30	1,187.50	1,188.90	1,186.30	2.60	183,061	-21,007	736,081	-1,489
USD010	1,187.50	-1.00	1,187.60	1,188.70	1,186.20	2.50	6,324	-644	16,513	1,902
USD SPOT	1,186.40	-1.90	1,187.00	1,188.90	1,186.20	2.70	4,928	-329	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	59,912	52,934	6,978	29,475	-15,504
은행	781	30	751	1,053	6,419
투신	1,937	981	956	3,550	35,498
보험	228	10	218	71	-7,634
기타법인	8,498	6,649	1,849	-3,664	-2,363
개인	18,782	17,769	1,013	1,241	8,562
외국인	101,152	112,917	-11,765	-31,726	-24,948

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,401.91	17.69
국고채3Y	0.949	-0.024
국고채10Y	1.555	-0.017

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	22.613	-0.020

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-299	-8,106	-34,322
KOSDAQ	-758	57	98
국고채	8,513	20,690	30,895
통안채	1,914	701	18,529

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.15550	-0.00013
Call	0.500	0.020	3M	0.24950	0.00775
CD	0.630	0.000	6M	0.30100	0.00775
통안1년	0.704	-0.014	12M	0.42700	0.00600

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,500.89	-632.42	-2.25	-3.27
S&P	3,331.84	-95.12	-2.78	-4.81
나스닥	10,847.69	-465.44	-4.11	-7.88
FTSE 100	5,930.30	-7.10	-0.12	1.16
DAX 30	12,968.33	-131.95	-1.01	-0.05
Nikkei 225	23,274.13	184.18	0.80	0.59
Shanghai	3,316.42	23.83	0.72	-2.76
항셍 H	9,830.39	65.57	0.67	-1.83
미국채 2년	0.14	0.00	-1.40	7.56
미국채 10년	0.68	-0.04	-5.46	1.48
WTI	36.84	-2.93	-7.37	-13.54
Gold	1,939.01	10.41	0.54	-1.83

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	0.00	-0.05
3M	-0.30	-0.05
6M	-0.80	0.00
12M	-2.10	0.20

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.105	0.020
2Y	0.015	0.020
3Y	0.050	0.020
4Y	0.075	0.025
5Y	0.125	0.025

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	93.474	0.755	1.23	USD/KRW	1,186.45	-1.80	0.28	USD/RUB	76.2943	0.5331	3.68
EUR/USD	1.1778	-0.0039	-1.12	USD/CNY	6.8464	0.0159	0.27	USD/BRL	5.3622	0.0606	-0.64
USD/JPY	106.03	-0.24	0.07	USD/HKD	7.7505	0.0003	0.01	USD/ZAR	16.9425	0.2020	1.74
GBP/USD	1.2982	-0.0184	-3.00	USD/SGD	1.3708	0.0046	0.69	USD/MXN	21.7793	0.1734	-0.02
USD/CHF	0.9178	0.0017	0.92	USD/TWD	29.392	-0.030	-0.13	USD/PLN	3.7807	0.0277	2.63
AUD/USD	0.7214	-0.0063	-2.14	USD/INR	73.60	0.25	1.00	USD/TRY	7.4849	0.0348	1.58
NZD/USD	0.6619	-0.0073	-2.07	USD/IDR	14,765	25	1.32	USD/SEK	8.8310	0.0606	1.68
USD/CAD	1.3236	0.0138	1.32	USD/THB	31.438	-0.010	1.16	USD/NOK	9.1305	0.1975	4.22

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point

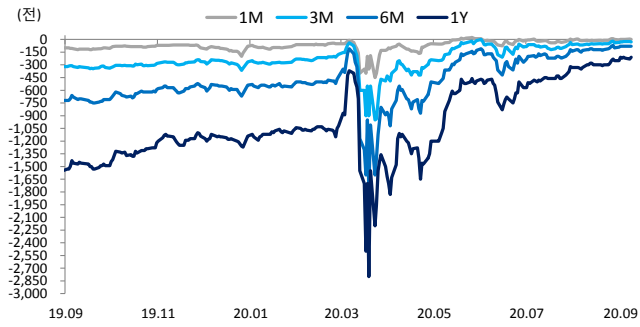


차트. CRS

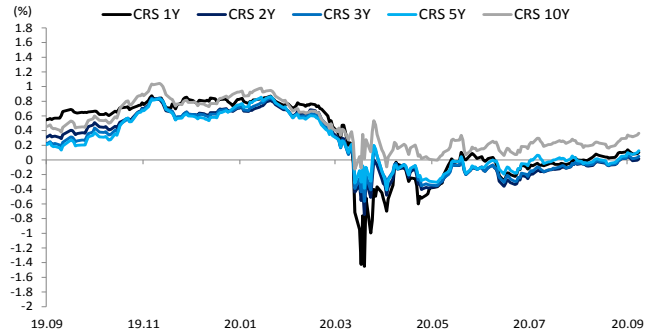


차트. IRS

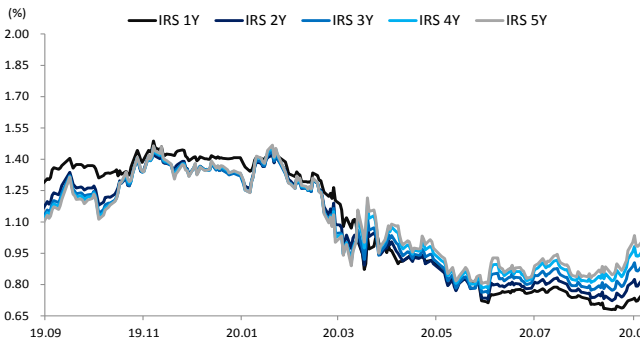


차트. CDS Premium 5Y

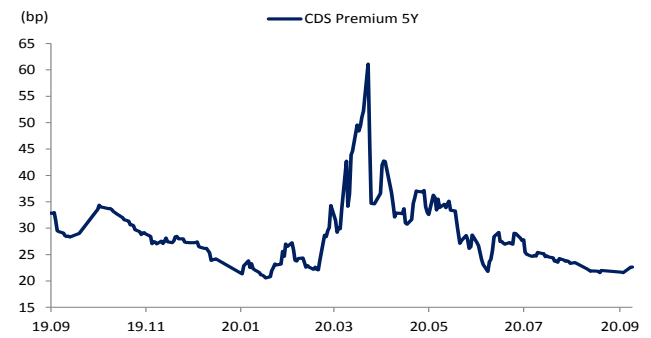


차트. 달러/위안

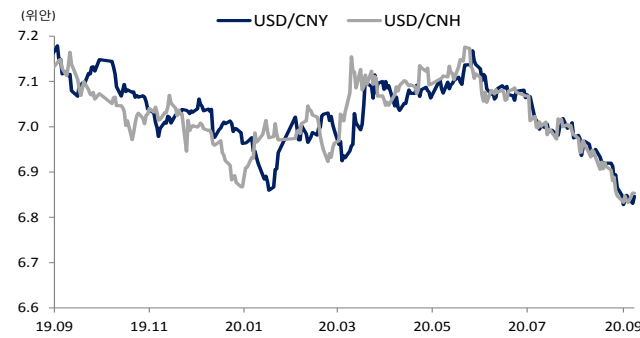


차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수

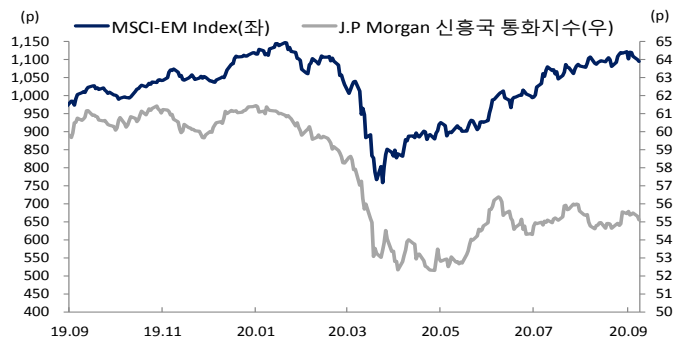


차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율

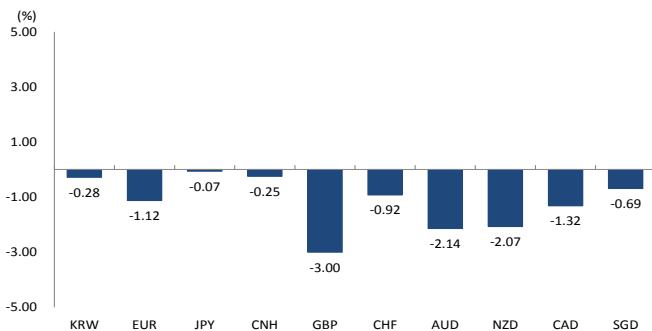


차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율

