

## FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

## ◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD010	1156.80	▼3.2	7.1	812,335
USD011	1157.10	▼3.9	5.7	302
USD/KRW	1158.00	▼2.3	6.8	
USD/CNY	6.7606	▼0.0029	0.0083	

## ◇ 전일 해외시장 동향

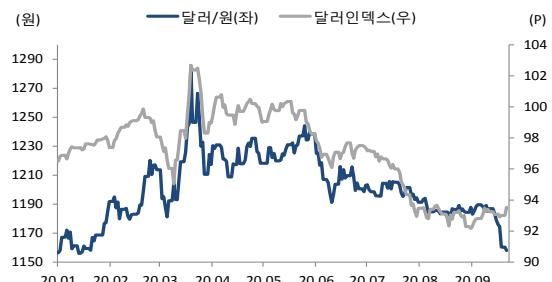
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.540	▲0.6140	UST2Y	0.1371
EUR/USD	1.1771	▼0.0069	UST10Y	0.6658
USD/JPY	104.65	▲0.0800	UST30Y	1.4148
GBP/USD	1.2817	▼0.0100	WTI	39.31

## 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(09/21)

21:30 미국 8월 시카고 연은 국가활동지수(결과:0.79, 예상:-0.79, 이전:1.18)  
(09/22)

01:00 미국 Fed 라엘 브레이너드 이사 연설

## 유럽 재봉쇄 가능성 언급

금일 달러/원 예상 : 1,162.00~1,169.00

NDF 최종호가 : 1,164.70/1,165.10(+6.80)

야간달러선물 종가 : 1,165.00원 | 고가:1,167.00원 | 저가:1,161.00원

## 전일 국내 동향

달러/원은 전일대비 3.7원 상승한 1,164원에 개장. 개장가를 고점으로 형성한 뒤 역외 매도세에 소폭 하락했으나 결제수요 우위에 1,160원 초반을 지지. 이후 1,160원을 하향 이탈하자 롱스탑 물량이 유입, 낙폭을 확대하여 1150원대에 진입. 이에 달러/원은 전일대비 2.3원 하락한 1,158원에 마감.

## 전일 해외 동향

달러화는 코로나19 확진자 수 증가로 인한 재봉쇄 우려 부각 속 안전자산 선호 강세에 상승. 유럽 주요국의 확진자가 급증에 일부 국가에서 봉쇄 강화를 검토. 스페인은 마드리드에 이동제한령을 내렸고 영국은 영업제한 등을 포함한 서킷 브레이커 발동을 검토한다 밝힘. 재봉쇄 우려에 미국, 유럽 증시 등 주요 위험 자산은 급락. 나우지수는 -1.84%, Euro Stoxx는 -3.74%에 마감.

또한 대법관 인선을 둘러싼 미국의 정치적 불안정성도 대두. 민주당은 후임 연방 대법관 인선을 11월로 미룰 것을 요청했으나 트럼프 대통령은 강행 의사를 밝힘. 이에 정치적 불확실성이 가중되며 추가 부양책 협의 난항 가능성도 부각.

유로화는 역내 코로나19 확산 우려 속 위험회피 기조에 하락. ECB의 구두개 입성 발언 또한 유로화 하락에 일조. 라가르드 ECB 총재는 이날 "유로화 절상에 매우 주의하고 있다"고 밝언. 국제유가는 유럽 일부 국가 재봉쇄 우려와 리비아 원유 수출 재개에 따른 공급 과잉 우려에 4% 이상 급락.

## 금일 전망

금일 달러/원은 코로나19 재확산에 따른 글로벌 안전자산 선호 회복과 달러 강세의 영향을 좋아 상승 압력이 우위를 보일 것으로 전망.

간밤 유럽 일부 국가 재봉쇄 고려 소식과 주요 은행의 불법거래 연루 의혹 보도에 미국, 유럽 등 글로벌 주요증시가 낙폭을 확대. 이는 위험선호 둔화와 함께 금일 아시아 주요증시에 하방 압력을 가중할 수 있으며 이는 환율 상승에 우호적인 재료. 특히 국내증시에서 외국인들이 안전자산 선호 기조 속 매도세를 이어갈지 등 외인 자금이탈 방향에 주목해야 할 것으로 보임. 밤사이 가파른 환율 상승에 솟 커버링 물량이 유입될 수 있는점 또한 환율 상승에 일조 가능.

다만 최근 급격한 환율 하락에 추격매도세를 보인 네고물량이 상단에 대기하는 점은 상승폭을 제한 가능한 요인. 이에 금일 달러/원은 글로벌 달러 강세에 연동하여 1,160원대를 회복할 것으로 보이나 국내증시, 외국인 자금동향과 네고물량 출회를 주시하며 상승폭 조절을 예상.

## 금 일(09/22)

23:00 유럽 9월 소비자기대지수(예상:-15.0, 이전:-14.7)  
23:00 미국 8월 기준주택매매(예상:6.00m, 이전:5.86m)  
23:00 미국 9월 리치몬드 연은 제조업지수(예상:12, 이전:18)  
23:30 미국 Fed 제롬 파월 의장 증언

## 익 일(09/23)

15:00 독일 10월 Gfk 소비자 기대지수(예상:-1.0, 이전:-1.8)  
16:30 독일 9월 마켓 제조업 PMI(P)(예상:52.5, 이전:52.2)  
17:00 유로존 9월 마켓 제조업 PMI(P)(예상:51.9, 이전:51.7)  
22:45 미국 9월 마켓 제조업 PMI(P)(예상:53.3, 이전:53.1)  
23:00 미국 Fed 제롬 파월 의장 증언  
(09/24)  
03:00 미국 Fed 랜들 웰스 이사 연설

## USD Futures &amp; Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD010	1,156.80	-3.20	1,163.20	1,163.90	1,156.80	7.10	298,487	39,650	812,335	17,398
USD011	1,157.10	-3.90	1,162.80	1,162.80	1,157.10	5.70	90	8	302	50
USD SPOT	1,158.00	-2.30	1,164.00	1,164.00	1,157.20	6.80	7,364	-2,952	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	166,061	130,302	35,759	49,204	65,736
은행	62,751	44,682	18,069	6,479	12,297
투신	3,049	6,787	-3,738	-15,801	-7,416
보험	898	905	-7	681	-2,483
기타법인	14,526	12,855	1,671	26,424	32,548
개인	33,070	39,498	-6,428	23,033	49,716
외국인	166,937	212,263	-45,326	-90,080	-150,418

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,389.39	-23.01
국고채3Y	0.904	-0.003
국고채10Y	1.493	-0.010

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	25.790	0.053

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-783	3,771	-19,095
KOSDAQ	-1,493	-815	-2,705
국고채	702	5,875	52,982
통안채	623	1,622	14,652

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.15188	-0.00387
Call	0.500	0.070	3M	0.22325	-0.00213
CD	0.630	0.000	6M	0.27288	-0.00237
통안1년	0.685	-0.001	12M	0.37850	0.00462

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,147.70	-509.72	-1.84	-3.02
S&P	3,281.06	-38.41	-1.16	-3.03
나스닥	10,778.80	-14.48	-0.13	-2.51
FTSE 100	5,804.29	-202.76	-3.38	-3.68
DAX 30	12,542.44	-573.81	-4.37	-4.94
Nikkei 225	23,360.30	40.93	0.18	-0.20
Shanghai	3,316.94	-21.16	-0.63	1.16
항셍 H	9,640.42	-162.68	-1.66	-1.69
미국채 2년	0.14	0.00	-1.44	0.07
미국채 10년	0.67	-0.03	-4.02	-0.97
WTI	39.31	-1.80	-4.38	5.50
Gold	1,902.92	-47.94	-2.46	-2.73

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.05	0.00
3M	0.00	0.10
6M	-0.30	0.20
12M	-1.00	0.40

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.165	0.015
2Y	0.070	0.010
3Y	0.095	0.005
4Y	0.145	0.005
5Y	0.225	0.005

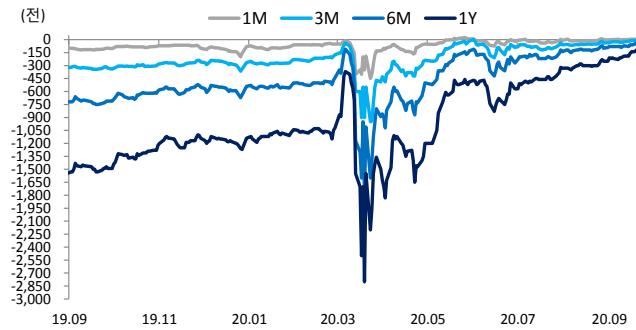
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.540	0.614	0.52	USD/KRW	1,158.00	-2.45	-2.16	USD/RUB	76.1310	0.4007	1.16
EUR/USD	1.1771	-0.0069	-0.80	USD/CNY	6.8053	0.0362	-0.08	USD/BRL	5.4147	0.0262	2.72
USD/JPY	104.65	0.08	-1.02	USD/HKD	7.7501	0.0000	0.00	USD/ZAR	16.7822	0.4548	0.70
GBP/USD	1.2817	-0.0100	-0.23	USD/SGD	1.3622	0.0023	-0.16	USD/MXN	21.3445	0.2122	1.14
USD/CHF	0.9145	0.0029	0.67	USD/TWD	29.077	-0.008	-0.98	USD/PLN	3.8181	0.0507	1.89
AUD/USD	0.7224	-0.0065	-0.88	USD/INR	73.40	-0.05	-0.11	USD/TRY	7.6272	0.0647	1.85
NZD/USD	0.6668	-0.0091	-0.48	USD/IDR	14,700	-35	-1.21	USD/SEK	8.8468	0.0810	0.89
USD/CAD	1.3308	0.0104	1.00	USD/THB	31.230	0.127	-0.33	USD/NOK	9.2770	0.1828	2.68

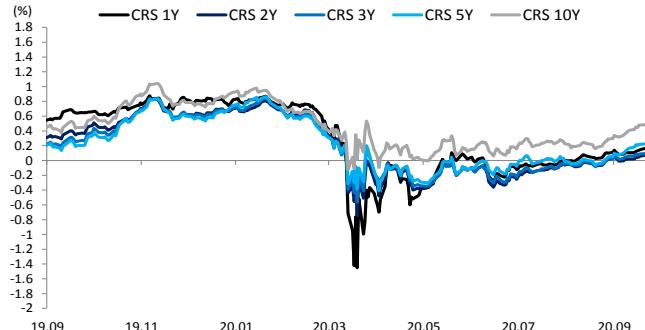
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



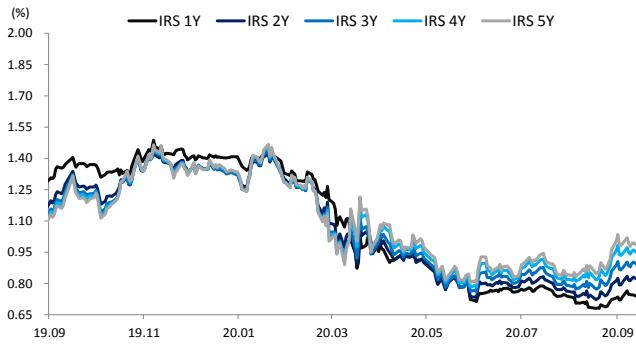
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



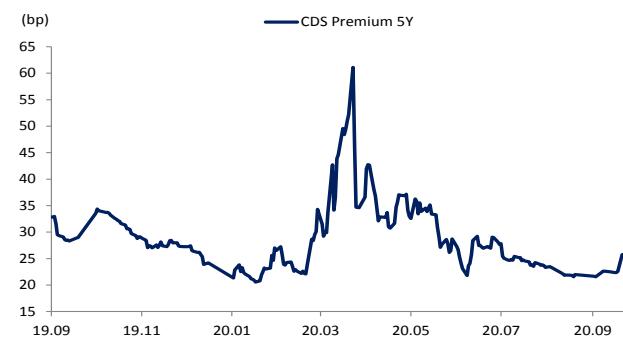
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



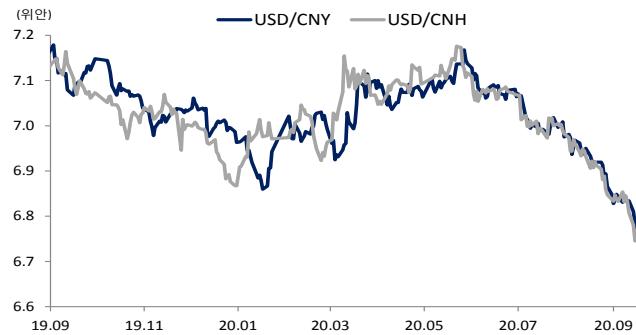
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



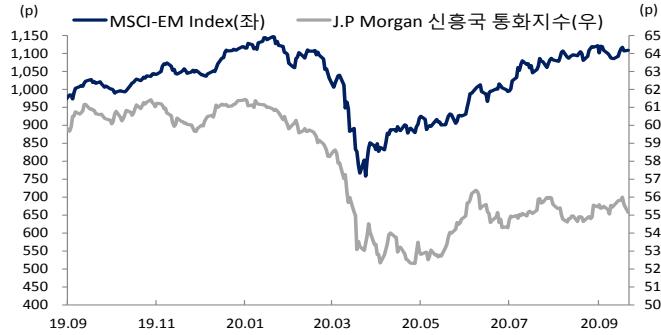
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



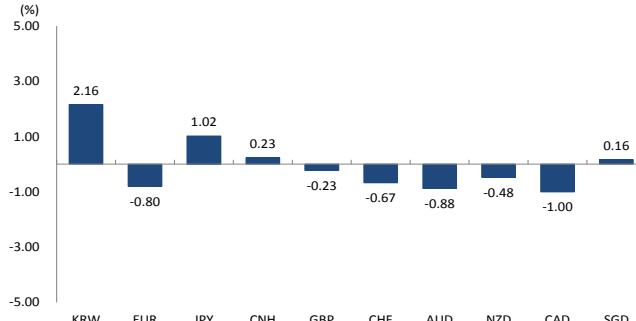
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



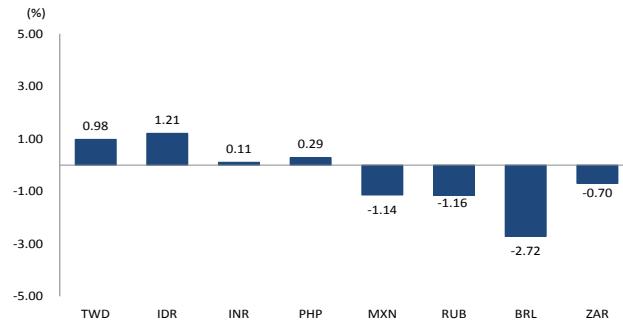
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터