

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD010	1172.40	▼1.1	5.1	785,212
USD011	1172.90	▼0.1	4.9	3,686
USD/KRW	1172.30	▼0.4	5.1	
USD/CNY	6.8201	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	94.642	▲0.2880	UST2Y	0.1289
EUR/USD	1.1631	▼0.0041	UST10Y	0.6544
USD/JPY	105.58	▲0.1700	UST30Y	1.4007
GBP/USD	1.2746	▼0.0001	WTI	40.25

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/25)	금 일(09/28)	익 일(09/29)
17:00 유로존 8월 M3 통화공급 YoY(결과:9.5%, 이전:10.1%)	14:00 일본 7월 선행지수(F)(예상:--, 잠정:86.9)	21:25 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권) 총재 연설
21:30 미국 8월 내구재 주문(P)(결과:0.4%, 이전:11.7%)	23:30 미국 9월 달러스 연은 제조업지수(예상:8.5, 이전:8.0)	22:30 미국 Fed 패트릭 하커(밀라델피아, 투표권) 총재 연설
22:00 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권) 총재 연설	(09/29)	21:30 미국 8월 도매재고 MoM(P)(예상:--, 이전:-0.3%)
	03:00 미국 Fed 로레타 메스터(클리블랜드, 투표권) 총재 연설	23:00 미국 9월 CB 소비자지수(예상:90.0, 이전:84.8)
		(09/30)
		00:40 미국 Fed 리처드 클라리다 부의장 연설
		02:00 미국 Fed 랜들 웰스 부의장 연설

코로나 재확산, 美 정치불안의 더블 악재

금일 달러/원 예상 : 1,171.00~1,178.00

NDF 최종호가 : 1,174.30/1,174.80(+2.15)

야간달러선물 증가 : 1,174.80원 | 고가:1,177.20원 | 저가:1,172.30원

전일 국내 동향

달러/원은 전일대비 3.2원 하락한 1,169.5원에 개장. 개장 직후 1,168.7원에 저점을 형성한 후 결제 유입, 네고 출회의 수급 공방 속 1,170원을 중심으로 횡보. 이후 장 후반 역외 위안화의 약세폭 확대와 결제수요가 우위에 낙폭을 되돌려 전일대비 0.4원 하락한 1,172.3원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 미국 대선을 앞둔 정치적 불확실성과 유럽내의 가파른 코로나19 재확산세에 따른 유로화 약세가 부각되며 상승 마감.

미 정치 불안과 부양책 합의 난항은 시장에 우려를 자극. 현재 민주당은 1조 달러를 감액한 2.4조 달러 규모의 부양책을 추진중에 있으나 규모에 대한 여전한 이견과 정치권 긴장 고조에 11월 대선 이전 합의가 어려울 수도 있다는 의견도 존재. 이에 더해 트럼프 대통령이 긴즈버그 연방 대법관 후임자를 지명하겠다고 밝히자 양당간 갈등이 지속. 트럼프의 대선 불복 가능성 발언 또한 정치적 불확실성과 함께 위험회피 심리를 자극.

급격한 유럽내 코로나19 재확산과 봉쇄 강화 추세는 유로화 투심 악화와 안전 자산 선호 회복을 야기하며 달러 강세에 일조. 독일은 4월 말 이후 최대의 일일 신규 확진자를 기록. 프랑스는 연일 확진자가 1만명을 넘어섬. 스페인은 마드리드에 대한 추가 봉쇄를 권고. 이는 유럽의 경기회복 둔화 우려를 키움.

금일 전망

금일 달러/원은 간밤의 안전 선호 회복과 유로화 약세가 촉발한 달러 강세의 영향 속 상승 압력이 우세할 것으로 전망. 급격한 바이러스 재확산에 봉쇄 강화가 고려되는 점은 위험통화인 유로화 투심 악화를 지속시킬 수 있어 기타 위험통화 등락에도 영향줄 것. 또한 지난 주 코스피 시장에서 4천억원 이상을 순매도한 외국인들의 매도기조가 계속될 지에도 주목. 이에 더해 최근 수급상 저가매수, 결제 수요 유입이 지속되고 있다는 점도 금일 환율 상승에 우호적인 재료.

월말과 연휴라는 시기적 특수성에 기인한 수급상 네고 물량의 상단대기는 금일 환율의 상승폭을 제한 가능한 요인. 또한 연휴를 앞두고 줄어드는 거래량 속 연휴간 미국 대선 1차 토론, 중국 PMI, 미국 고용보고서 발표 등 한시에 영향을 끼칠 중요한 이벤트들이 준비한 점은 적극적 포지션 플레이에 대한 부담으로 작용할 수 있음. 이는 금일 환율의 변동폭을 제한가능한 요소. 이에 금일 환율은 상승 출발한 뒤 1,170원 중반을 중심으로 제한된 등락을 보일 것으로 예상.

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD010	1,172.40	-1.10	1,169.40	1,173.70	1,168.60	5.10	332,719	-39,131	785,212	-28,093
USD011	1,172.90	-0.10	1,169.60	1,173.50	1,168.60	4.90	2,688	543	3,686	651
USD SPOT	1,172.30	-0.40	1,169.50	1,173.80	1,168.70	5.10	8,191	-931	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	85,678	104,347	-18,669	49,157	87,754
은행	1,101	3,460	-2,359	25,790	19,239
투신	707	376	331	-7,821	-11,517
보험	542	76	466	1,983	2,327
기타법인	5,538	7,568	-2,030	-8,869	17,798
개인	25,597	27,759	-2,162	-34,442	6,601
외국인	216,289	191,866	24,423	-25,798	-122,262

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,278.79	6.09
국고채3Y	0.855	-0.002
국고채10Y	1.424	-0.013

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	28.092	-0.013

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-898	-4,323	-23,628
KOSDAQ	649	-767	-862
국고채	-446	5,356	60,684
통안채	-1,499	1,237	16,726

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14613	0.00138
Call	0.480	0.000	3M	0.21788	-0.01537
CD	0.630	0.000	6M	0.27125	-0.00225
통안1년	0.674	0.001	12M	0.36925	-0.00288

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,173.96	358.52	1.34	-1.75
S&P	3,298.46	51.87	1.60	-0.63
나스닥	10,913.56	241.29	2.26	1.11
FTSE 100	5,842.67	19.89	0.34	-2.74
DAX 30	12,469.20	-137.37	-1.09	-4.93
Nikkei 225	23,204.62	116.80	0.51	-1.15
Shanghai	3,219.42	-3.76	-0.12	-3.56
항셱 H	9,302.59	-68.60	-0.73	-5.11
미국채 2년	0.13	0.00	-2.94	-7.33
미국채 10년	0.65	-0.01	-1.73	-5.67
WTI	40.25	-0.06	-0.15	-2.09
Gold	1,870.66	4.21	0.23	-3.82

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	0.05	0.00
3M	0.05	0.10
6M	-0.50	0.10
12M	-1.60	0.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.100	-0.005
2Y	-0.030	-0.020
3Y	-0.020	-0.020
4Y	0.005	-0.040
5Y	0.070	-0.050

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화

*영업일 기준으로 집계

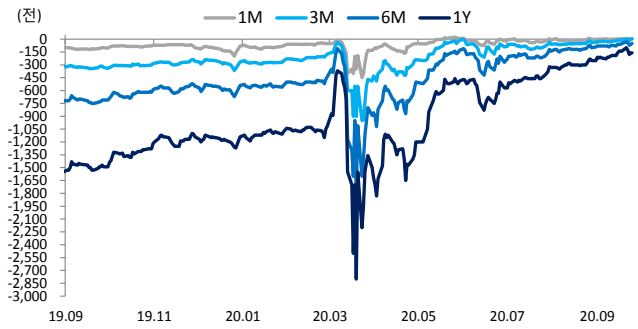
아시아 통화

기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	94.642	0.288	1.85	USD/KRW	1,172.50	-0.25	1.04	USD/RUB	78.1899	1.0565	3.25
EUR/USD	1.1631	-0.0041	-1.77	USD/CNY	6.8238	-0.0049	0.81	USD/BRL	5.5626	0.0524	3.23
USD/JPY	105.58	0.17	0.97	USD/HKD	7.7500	-0.0002	0.00	USD/ZAR	17.1313	0.2017	4.92
GBP/USD	1.2746	-0.0001	-1.32	USD/SGD	1.3776	0.0016	1.30	USD/MXN	22.3363	0.1835	5.70
USD/CHF	0.9283	0.0015	1.83	USD/TWD	29.208	-0.080	0.42	USD/PLN	3.9084	0.0054	3.74
AUD/USD	0.7031	-0.0016	-3.54	USD/INR	73.61	-0.29	0.22	USD/TRY	7.6639	0.0411	1.34
NZD/USD	0.6546	0.0000	-3.15	USD/IDR	14,873	-17	0.94	USD/SEK	9.1283	0.0287	4.14
USD/CAD	1.3386	0.0024	1.38	USD/THB	31.590	-0.042	1.57	USD/NOK	9.5737	0.0786	5.27

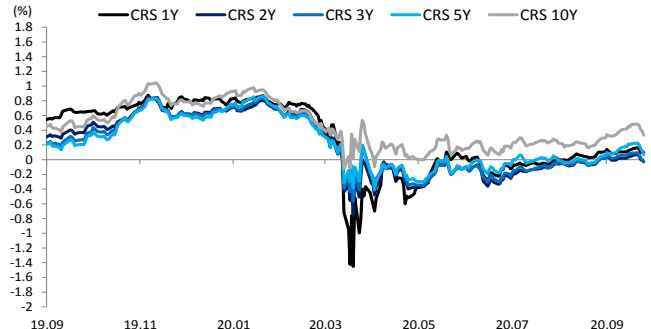
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



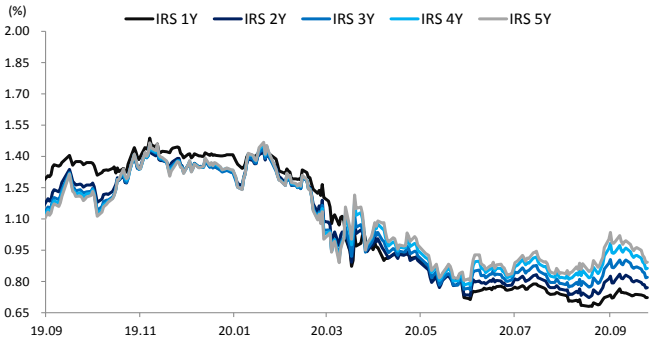
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



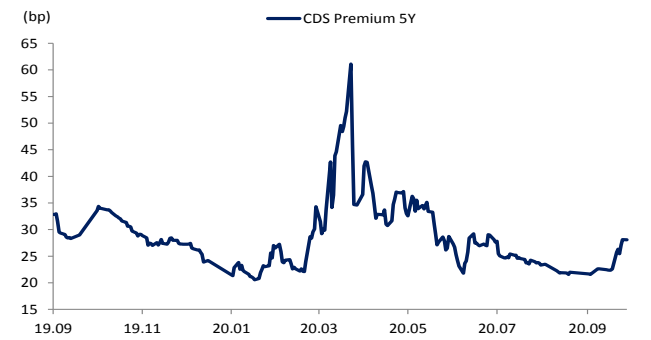
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



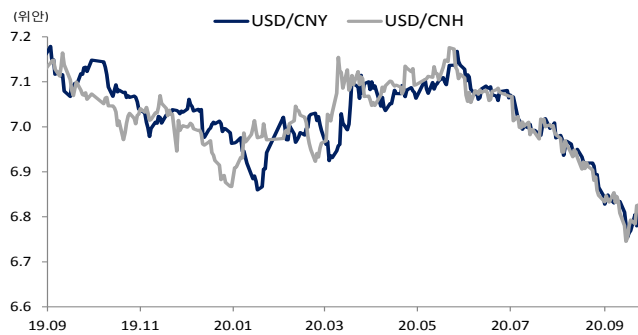
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



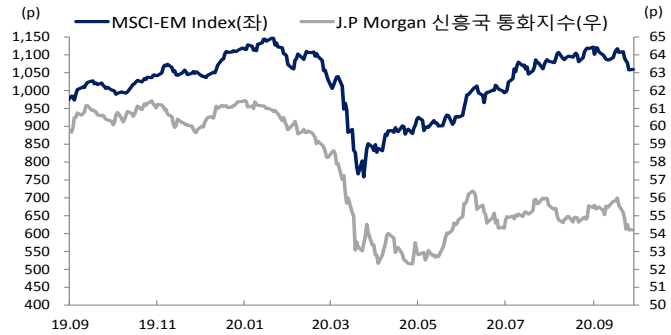
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



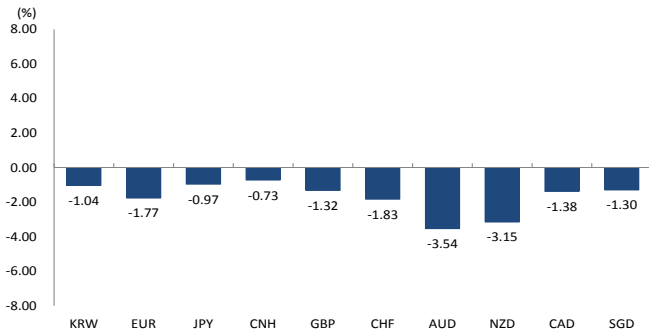
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



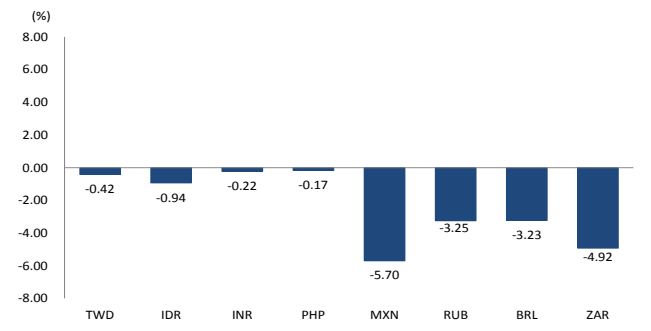
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

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.