

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

美 대선 전 초대형 변수, 트럼프 확진

금일 달러/원 예상 : 1,163.00~1,169.00

NDF 최종호가 : 1,166.30/1,166.70(-3.00)

야간달러선물 증가 : 1,168.70원 | 고가:1,170.00원 | 저가:1,167.20원

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일증가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD010	1170.00	▼2.8	3.6	742,782
USD011	1169.30	▼3.7	3.2	6,827
USD/KRW	1169.50	▼4.1	3.7	
USD/CNY	6.7908	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일증가	전일비(bp)	종목	전일증가
USD Index	93.844	▲0.1330	UST2Y	0.1289
EUR/USD	1.1716	▼0.0032	UST10Y	0.7005
USD/JPY	105.29	▼0.2400	UST30Y	1.4868
GBP/USD	1.2935	▲0.0044	WTI	37.05

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

전일 국내 동향

달러/원은 글로벌 위험선호 분위기 속 전일대비 6.1원 하락한 1,167.5원에 개장. 장 초반 저가매수 수요 유입에 1,171.2원 까지 고점을 높였으나 네고 출회에 상단이 제한되며 상승폭을 낮춤. 이후 연휴를 앞둔 관망세 속 1,160원 후반대에서 횡보하던 환율은 전일대비 4.1원 하락한 1,169.5원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 트럼프 미 대통령의 코로나19 확진으로 인한 안전자산 선호와 추가 부양책 합의 지연을 주시하는 가운데 상승. 트럼프의 확진 소식에 장 초반 증시가 낙폭을 확대하는 등 금융시장의 충격이 확대되며 안전선호 회복에 일조.

추가 부양안 합의는 여전히 난항. 펠로시 미 하원의장과 므누신 재무장관은 65분간 협상 끝에 합의에 실패. 다만 양측에서 합의에 속도가 나고 있다는 등 낙관적 발언이 나오며 합의에 대한 기대감이 확대. 월말과 분기말을 맞은 포트폴리오 리밸런싱 수요에 달러 매수세가 들어온 점도 달러 상승에 일조.

이날 발표된 경기지표는 혼조. 9월 고용보고서에 따르면 비농업부문 고용자수가 66.1만명 증가하여 시장예측(85.9만)과 전월치(148.9만)을 큰 폭 하회. 다만 실업률은 7.9%로 예상치를 하회하며 감소세를 이어감.

트럼프 확진 이슈 속 증시 하락과 변동성 확대에 안전통화인 엔화는 달러대비 강세를 보이며 달러의 상승폭을 제한. 안전선호 기조 속 유로화는 약세 마감.

금일 전망

금일 달러/원은 간밤 뉴욕 차액결제선물환 시장 종가를 반영하여 하락 출발을 예상하나 연휴 간의 이슈를 소화하며 하락폭은 제한될 것으로 전망. 미국의 정치적 불확실성으로 인한 글로벌 리스크 오프 심리는 달러/원에 상승 압력을 가중하는 요인. 이로인한 외인 자금 동향에 주시해야 할 것. 외국인들은 연휴 직전까지 KOSPI에서 7거래일간 약 6천억원을 순매도. 트럼프의 코로나19 확진으로 인한 금융시장 쇼크와 변동성 확대 기조는 한국을 비롯한 아시아 주요증시에 하락 압력을 가중할 가능성이 높으며 외인 자금 이탈을 촉발할 수 있음.

수급상 수입업체 매수 수요가 우위를 보일 것으로 전망되는 점도 하단을 경직시킬 것으로 전망. 연휴전 월말과 분기말에 따른 네고물량이 출회되어 꾸준한 유입을 보여온 저가매수 수요가 수급상 주도권을 가질 것. 다만 장중 퇴원을 앞둔 트럼프 건강 이슈 소화와 역외 위안 등락은 상단을 제한할 수도. 이에 금일 환율은 연휴간 의 이벤트에 하단이 경직된 가운데 1,160원 중반 등락을 예상.

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(09/29)	금 일(10/05)	익 일(10/06)
21:25 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권) 총재 연설	09:00 호주 9월 인플레이션 MoM(예상:~, 이전:1.3%)	08:00 한국 9월 CPI YoY(예상:~, 이전:0.7%)
21:30 미국 8월 도매재고 MoM(P)(결과:0.5%, 이전:-0.3%)	16:55 독일 9월 마켓 종합 PMI(F)(예상:53.7, 잠정:53.7)	15:00 독일 8월 제조업수주 MoM(예상:~, 이전:2.8%)
22:30 미국 Fed 패트릭 하커(필라델피아, 투표권) 총재 연설	17:00 유로존 9월 마켓 종합PMI(F)(예상:50.1, 잠정:50.1)	21:30 미국 8월 무역수지(예상:\$64.9b, 이전:\$63.6b)
23:00 미국 9월 CB 소비자지대지수(결과:101.8, 이전:84.8)	18:00 유로존 8월 소매판매 MoM(예상:2.5%, 이전:-1.3%)	22:00 유럽 ECB 라가르드 총재 연설
(09/30)	22:45 미국 9월 마켓 종합 PMI(F)(예상:~, 잠정:54.4)	
00:40 미국 Fed 리처드 클라리다 부의장 연설	23:00 미국 9월 ISM 서비스지수(예상:56.2, 이전:56.9)	
02:00 미국 Fed 랜들 웰스 부의장 연설		

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD010	1,170.00	-2.80	1,167.40	1,170.90	1,167.30	3.60	288,508	40,698	742,782	-43,263
USD011	1,169.30	-3.70	1,167.50	1,170.70	1,167.50	3.20	3,532	-1,228	6,827	-1,277
USD SPOT	1,169.50	-4.10	1,167.50	1,171.20	1,167.50	3.70	6,458	706	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	48,597	76,743	-28,146	-72,442	78,390
은행	3,572	4,054	-482	9,017	19,648
투신	1,799	2,293	-494	-3,788	-13,350
보험	419	1,977	-1,558	-509	3,076
기타법인	4,305	4,953	-648	-8,506	14,864
개인	33,686	26,481	7,205	-6,290	8,877
외국인	199,832	175,769	24,063	82,558	-111,525

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,327.89	19.81
국고채3Y	0.846	0.003
국고채10Y	1.430	0.004

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	26.357	0.082

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-736	-4,722	-6,569
KOSDAQ	-608	604	-2,077
국고채	6,101	7,341	55,504
통안채	0	5,394	18,839

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14000	0.00050
Call	0.530	0.050	3M	0.23350	-0.00050
CD	0.630	0.000	6M	0.24475	-0.00575
통안1년	0.674	0.003	12M	0.35750	-0.00238

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,682.81	-134.09	-0.48	1.87
S&P	3,348.44	-32.36	-0.96	1.52
나스닥	11,075.02	-251.49	-2.22	1.48
FTSE 100	5,902.12	22.67	0.39	1.02
DAX 30	12,689.04	-41.73	-0.33	1.76
Nikkei 225	23,029.90	-155.22	-0.67	-0.75
Shanghai	3,218.05	-6.31	-0.20	-1.88
항셍 H	9,397.37	115.85	1.25	-1.69
미국채 2년	0.13	0.00	1.50	0.00
미국채 10년	0.70	0.02	3.41	7.04
WTI	37.05	-1.67	-4.31	-7.95
Gold	1,908.64	10.74	0.57	2.03

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	0.00	-0.05
3M	-0.15	-0.15
6M	-0.60	-0.10
12M	-1.80	-0.20

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.080	0.005
2Y	-0.065	0.005
3Y	-0.060	0.005
4Y	-0.035	0.005
5Y	0.030	0.010

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	93.844	0.133	-0.84	USD/KRW	1,169.60	-3.90	0.39	USD/RUB	78.1920	0.8482	0.00
EUR/USD	1.1716	-0.0032	0.73	USD/CNY	6.7908	-0.0251	-0.27	USD/BRL	5.6861	0.0400	2.22
USD/JPY	105.29	-0.24	-0.27	USD/HKD	7.7503	0.0002	0.00	USD/ZAR	16.5283	-0.0804	-3.52
GBP/USD	1.2935	0.0044	1.48	USD/SGD	1.3638	0.0003	-1.00	USD/MXN	21.6163	-0.2091	-3.22
USD/CHF	0.9206	0.0017	-0.83	USD/TWD	29.039	-0.037	-0.39	USD/PLN	3.8438	0.0286	-1.65
AUD/USD	0.7161	-0.0024	1.85	USD/INR	73.15	-0.62	-1.03	USD/TRY	7.7748	0.0315	1.45
NZD/USD	0.6641	0.0005	1.45	USD/IDR	14,865	30	-0.05	USD/SEK	8.9357	0.0219	-2.11
USD/CAD	1.3308	0.0019	-0.58	USD/THB	31.600	0.023	0.03	USD/NOK	9.3163	0.0152	-2.69

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point

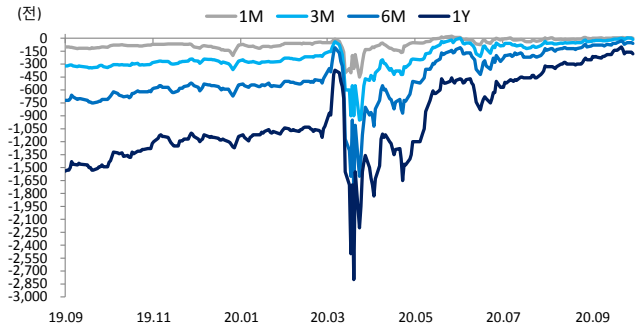


차트. CRS

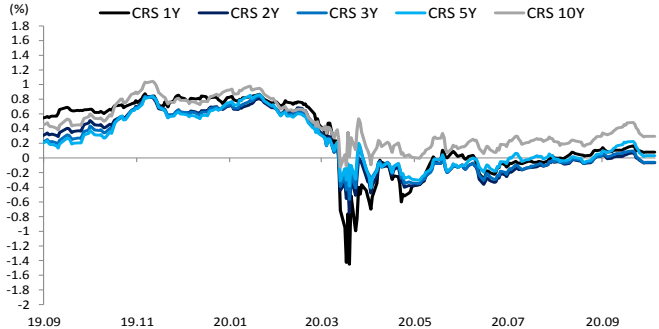


차트. IRS

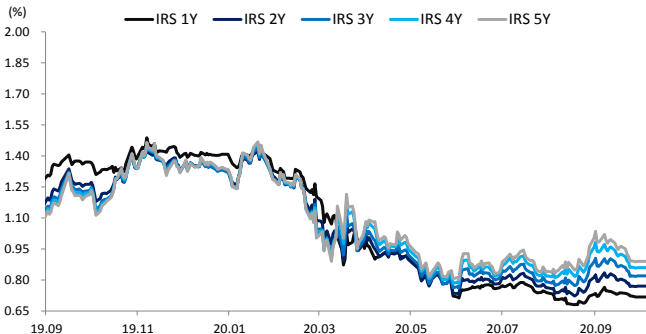


차트. CDS Premium 5Y

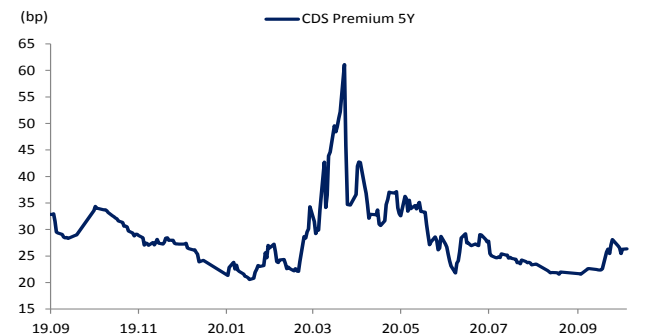


차트. 달러/위안

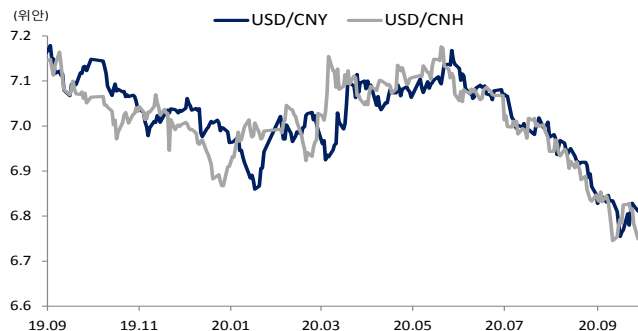


차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수

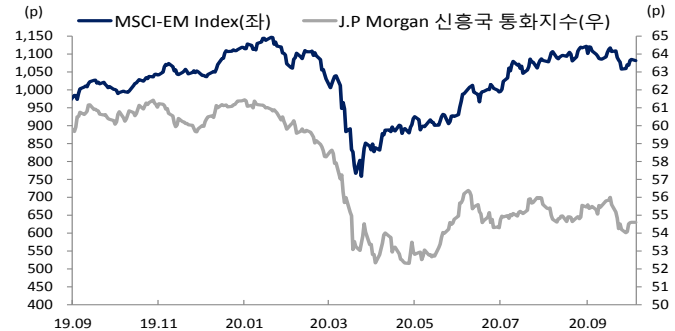


차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율

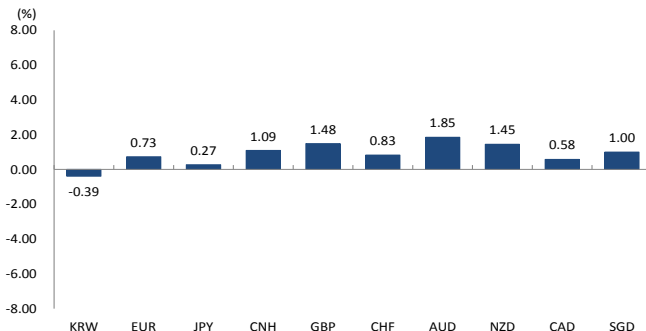


차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율

