

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일증가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD010	1163.60	▼6.4	6.0	736,565
USD011	1163.30	▼6.0	5.7	6,351
USD/KRW	1163.40	▼6.1	5.4	
USD/CNY	6.7908	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일증가	전일비(bp)	종목	전일증가
USD Index	93.466	▼0.3780	UST2Y	0.1447
EUR/USD	1.1783	▲0.0067	UST10Y	0.7817
USD/JPY	105.75	▲0.4600	UST30Y	1.5892
GBP/USD	1.2979	▲0.0044	WTI	39.22

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(10/05)	금 일(10/06)	익 일(10/07)
16:55 독일 9월 마켓 종합 PMI(F)(결과:54.7, 잠정:53.7)	08:00 한국 9월 CPI YoY(예상:0.4%, 이전:0.7%)	15:00 독일 8월 산업생산 MoM(예상:1.7%, 이전:1.2%)
17:00 유로존 9월 마켓 종합PMI(F)(결과:50.4, 잠정:50.1)	15:00 독일 8월 제조업수주 MoM(예상:2.9%, 이전:2.8%)	20:00 미국 MBA 주택융자 신청지수(예상:--, 이전:-4.8%)
18:00 유로존 8월 소매판매 MoM(결과:4.4%, 이전:-1.8%)	21:30 미국 8월 무역수지(예상:-\$64.9b, 이전:-\$63.6b)	23:30 미국 DOE 주간 원유재고(예상:--, 이전:-1980k)
22:45 미국 9월 마켓 종합 PMI(F)(결과:54.3, 잠정:54.4)	22:00 유럽 ECB 라가르드 총재 연설 (10/06)	03:00 미국 FOMC 회의록 (10/08)
23:00 미국 9월 ISM 서비스지수(결과:57.8, 이전:56.9)	00:30 유럽 ECB 필립 레인 수석 이코노미스트 연설	04:00 미국 Fed 존 윌리엄스(뉴욕, 투표권) 총재 연설
	00:45 미국 Fed 패트릭 허커(필라델피아, 투표권) 총재 연설	05:30 미국 Fed 찰스 에반스(시카고) 총재 연설

## 트럼프 퇴원, 부양책 기대에 투심 회복

금일 달러/원 예상 : 1,152.00~1,160.00

NDF 최종호가 : 1,157.00/1,157.40(-6.15)

야간달러선물 증가 : 1,157.90원 | 고가:1,161.50원 | 저가:1,157.10원

### 전일 국내 동향

달러/원은 전일대비 3원 하락한 1,166.5원에 개장. 장초반 트럼프 대통령의 코로나19 확진 여파는 제한된 가운데 역외 위안 강세와 증시 상승에 연동하여 낙폭 키움. 이후 1,160원 초반대에서 좁은 폭 등락하다 장 후반 결제물량 유입에 하락폭을 소폭 만회. 이에 전일대비 6.1원 하락한 1,163.4원에 마감.

### 전일 해외 동향

달러화는 코로나19 확진 판정을 받은 트럼프 대통령의 퇴원 예정 소식과 추가 부양안 합의 기대에 증시가 상승하는 등 위험선호 회복에 약세 마감.

트럼프 대통령의 퇴원 소식에 더해 추가 부양책 합의 기대 또한 위험자산 투심 회복을 자극. 트럼프 대통령은 트위터를 통해 법안 합의를 촉구. 무늬만 장관과 펠로시 의장은 6일 막바지 절충을 위한 논의를 이어갈 것으로 알려짐. 이에 부양책이 대선 전 타결될 수 있다는 기대를 모음.

이날 발표된 경기지표는 호조. 미국 ISM 서비스지수는 57.8로 시장예측(56.2)과 이전 발표치(56.9)를 모두 상회.

유로화는 경기지표 호조 속 강세를 보이며 달러 하락에 일조. 이날 발표된 유로존 소매판매는 전월대비 4.4% 증가하며 시장예측(2.5%)을 상회. 독일과 유로존 PMI가 일제히 시장 예측치를 웃돈 점도 긍정적으로 작용. 파운드화는 영국-EU의 브렉시트 이후 무역에 대한 협상 강화 합의 소식에 상승.

### 금일 전망

금일 달러/원은 부양책 기대, 트럼프 대통령 퇴원 소식에 따른 글로벌 위험자산 선호 회복에 하락 압력 우세를 예상하며 1,150원대 안착 시도를 전망.

간밤 미 국채금리 상승, 국제유가 급등, 그리고 안전통화 약세 현상 등 금융시장 전반에 걸친 위험선호 회복 기조는 금일 국내증시 상승과 외국인 자금 유입에 영향줄 수 있음. 전일 외국인들은 KOSPI 시장에서 약 1,700억원을 순매수했으며 금일 또한 매수기조를 이어가며 원활한 수급을 보일 가능성 높음. 이는 환율 하락에 우호적인 요인. 최근의 원화 강세를 이끌었던 역외 위안 강세가 이어지는 점도 환율 하락에 우호적. 밤사이 역외 위안 환율은 낙폭을 확대하여 달러당 6.71 위안 레벨까지 하락.

다만 네고 소진 이후 수급상 주도권을 가진 결제수요, 저가매수 수요가 하단에서 대응하는 점은 환율의 하단을 제한. 특히 금일은 저가매수 수급 유입이 1,150원대 지지선을 결정할 중요한 요소로 작용할 가능성이 높음.

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD010	1,163.60	-6.40	1,167.00	1,167.10	1,161.10	6.00	273,354	-15,154	736,565	-6,217
USD011	1,163.30	-6.00	1,166.70	1,166.90	1,161.20	5.70	7,175	3,643	6,351	-476
USD SPOT	1,163.40	-6.10	1,166.50	1,166.50	1,161.10	5.40	6,390	-68	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	46,948	87,427	-40,479	-82,303	50,947
은행	4,447	471	3,976	4,318	23,524
투신	4,493	2,983	1,510	-1,662	-10,981
보험	2	187	-185	-980	3,279
기타법인	9,245	3,540	5,705	-1,281	22,658
개인	31,593	23,565	8,028	-1,929	23,255
외국인	184,417	163,052	21,365	83,797	-112,782

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, % , %p)

종목	증가/금리	전일비
KOSPI	2,358.00	30.11
국고채3Y	0.881	0.035
국고채10Y	1.479	0.049

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	25.741	0.111

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	1,740	-2,405	-2,269
KOSDAQ	-45	432	-3,584
국고채	4,471	10,437	55,470
통안채	999	6,401	21,146

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : % , %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14275	0.00275
Call	0.480	0.000	3M	0.22025	-0.01325
CD	0.630	0.000	6M	0.23375	-0.01100
통안1년	0.692	0.018	12M	0.34875	-0.00875

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	28,148.64	465.83	1.68	2.05
S&P	3,408.63	60.19	1.80	1.70
나스닥	11,332.49	257.47	2.32	1.93
FTSE 100	5,942.94	40.82	0.69	0.25
DAX 30	12,828.31	139.27	1.10	-0.33
Nikkei 225	23,312.14	282.24	1.23	-0.85
Shanghai	3,218.05	-6.31	-0.20	-1.88
항생 H	9,447.99	50.62	0.54	0.82
미국채 2년	0.14	0.02	12.26	15.76
미국채 10년	0.78	0.08	11.59	19.75
WTI	39.35	2.30	6.21	-3.08
Gold	1,916.41	16.57	0.87	2.23

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	-0.10	-0.10
3M	-0.30	-0.15
6M	-0.80	-0.20
12M	-2.10	-0.30

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : % , %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.065	-0.015
2Y	-0.045	0.020
3Y	-0.040	0.020
4Y	-0.015	0.020
5Y	0.050	0.020

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

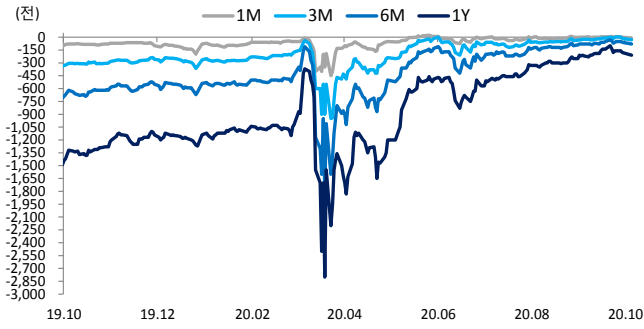
아시아 통화

기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	93.466	-0.378	-0.86	USD/KRW	1,163.40	-6.20	-0.86	USD/RUB	78.1044	-0.0876	-1.22
EUR/USD	1.1783	0.0067	1.00	USD/CNY	6.7908	-0.0251	-0.27	USD/BRL	5.5755	-0.1106	-1.53
USD/JPY	105.75	0.46	0.24	USD/HKD	7.7502	-0.0001	0.00	USD/ZAR	16.5837	0.0554	-2.77
GBP/USD	1.2979	0.0044	1.13	USD/SGD	1.3607	-0.0031	-0.90	USD/MXN	21.3972	-0.2191	-4.55
USD/CHF	0.9154	-0.0052	-1.05	USD/TWD	29.039	-0.037	-0.39	USD/PLN	3.8147	-0.0291	-2.97
AUD/USD	0.7181	0.0020	1.56	USD/INR	73.29	-0.48	-0.67	USD/TRY	7.7615	-0.0133	-0.57
NZD/USD	0.6646	0.0005	1.40	USD/IDR	14,800	-65	-0.67	USD/SEK	8.9001	-0.0356	-1.58
USD/CAD	1.3263	-0.0045	-0.80	USD/THB	31.415	-0.185	-1.00	USD/NOK	9.2159	-0.1004	-2.79

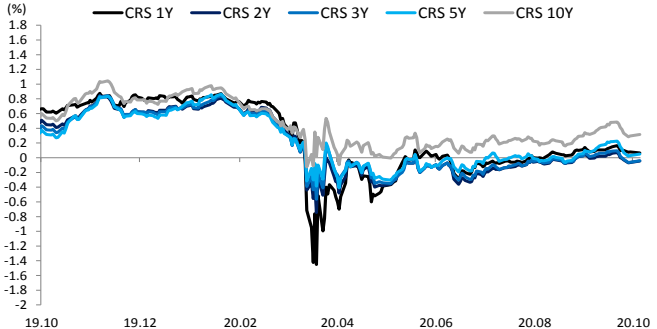
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



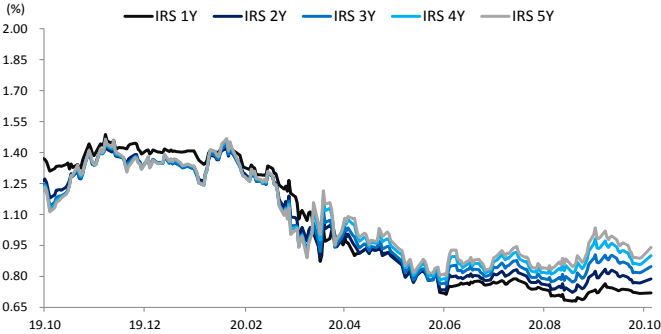
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



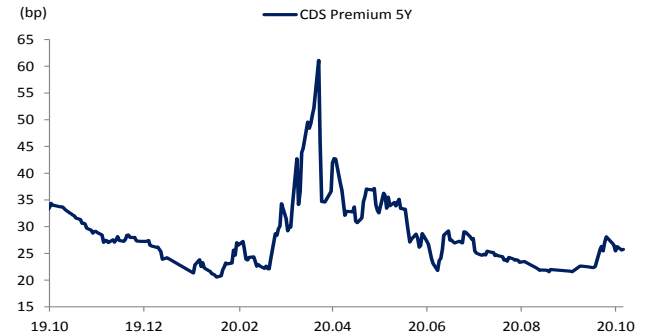
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



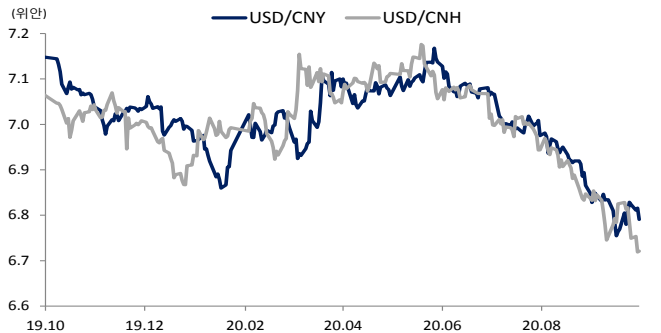
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



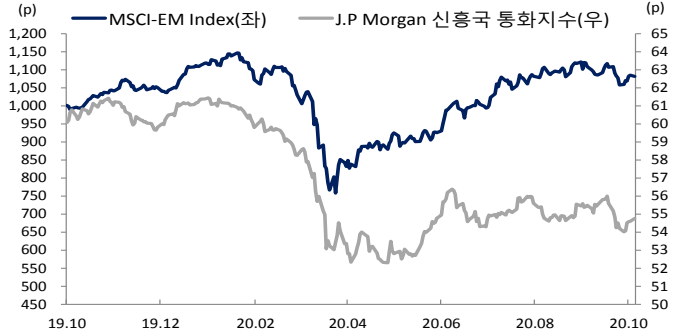
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



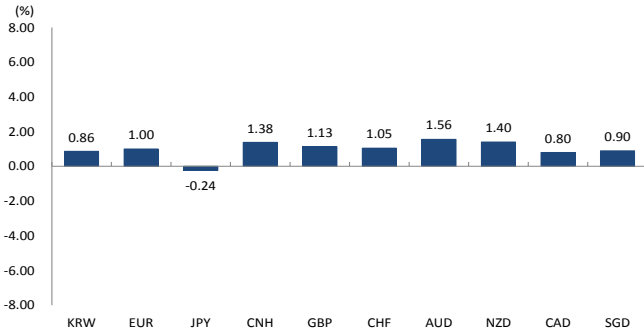
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



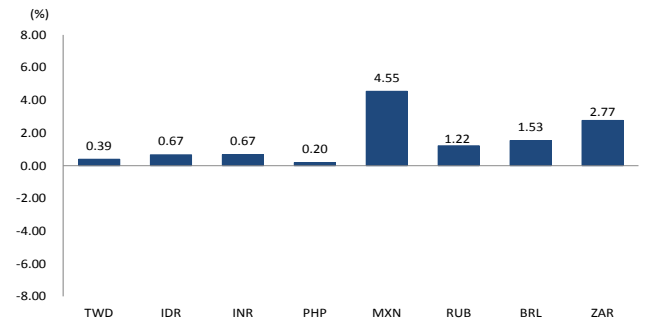
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

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.