

## FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

## ◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD010	1152.80	▼5.2	6.7	737,388
USD011	1152.80	▼5.5	6.4	22,363
USD/KRW	1153.30	▼4.9	5.5	
USD/CNY	6.7113	▼0.0029	0.0083	

## ◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.057	▼0.5480	UST2Y	0.1529
EUR/USD	1.1826	▲0.0067	UST10Y	0.7737
USD/JPY	105.62	▼0.4100	UST30Y	1.5717
GBP/USD	1.3036	▲0.0098	WTI	40.60

## 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(10/08)

17:00 유럽 ECB 루이 데 콘도스 부총재 연설  
21:30 미국 주간 신규실업수당 청구건수(결과:840k, 예상:849k)

## 금 일(10/12)

08:50 일본 9월 PPI YoY(예상:--%, 이전:-0.5%)  
08:50 일본 8월 핵심기계수주 MoM(예상:--%, 이전:6.3%)

## 의 일(10/13)

15:00 독일 9월 CPI YoY(F)(예상:--%, 잠정:-0.2%)  
18:00 독일 10월 ZEW 서베이(예상:--%, 이전:77.4)  
19:00 미국 9월 NFIB 소기업 낙관지수(예상:101.2, 이전:100.2)  
21:30 미국 9월 CPI YoY(예상:1.4%, 이전:1.3%)  
N/A 중국 9월 수출 YoY(예상:9.5%, 이전:9.5%)  
N/A 중국 9월 수입 YoY(예상:-0.3%, 이전:-2.1%)  
N/A 중국 9월 무역수지(예상:\$59.25b, 이전:\$58.93b)

## 위안화 초강세 영향에 원화까지

금일 달러/원 예상 : 1,140.00~1,148.00

NDF 최종호가 : 1,143.40/1,143.80(-9.75)

야간달러선물 종가 : 1,151.60원 | 고가:1,154.00원 | 저가:1,151.40원

## 전일 국내 동향

달러/원은 미국 부양책 합의 기대로 인한 달러 약세를 반영하여 전일대비 1.2원 하락한 1,157원에 개장. 장 초반 코스피가 낙폭을 확대하자 1,158.8원 까지 고점을 높이기도 했으나 역외에서 달러 매도세가 가중되자 재차 하락 전환. 이에 환율은 전일대비 4.9원 하락한 1,153.3원에 마감.

## 전일 해외 동향

달러화는 미국 추가 부양책 타결 기대가 고조된 점과 바이든 후보의 당선 가능성이 확대된 영향에 하락 마감.

트럼프 대통령은 이날 기존보다 2천억 달러 증액된 1.8조 달러 부양안을 제시하며 대규모 부양책 합의를 촉구. 합의 중단 선언을 번복하며 일부 항목 타결을 촉구한데 이어 증액으로 민주당과의 격차를 좁히자 대규모 재정정책에 대한 기대와 미중갈등 완화 기대가 달러 약세 재료로 소화.

바이든 후보와 트럼프 대통령의 지지율 격차가 확대되며 바이든의 당선 가능성이 높아지고 있는 점 또한 달러 하락에 일조. 양 후보간 지지율 격차가 두 자릿수까지 벌어지자 대규모 재정정책에 대한 기대와 미중갈등 완화 기대가 달러 약세 재료로 소화.

파운드화는 금주 브렉시트 관련 막판 협상을 앞둔 가운데 최근 협상 타결에 대한 긍정적 발언과 함께 기대가 고조되며 0.8% 가까이 상승.

## 금일 전망

금일 달러/원은 글로벌 약달러 기조와 위안화 강세 흐름이 견인하는 위험통화 상승 압력에 하방 압력이 우세할 것으로 전망.

휴일 간 역외 위안 환율이 한때 6.69위안을 하회하는 등 위안화가 강세를 보임. 이에 역외 시장에서 달러/원 또한 10원 가까이 급락하며 올들어 처음으로 1,140원대에 진입. 글로벌 증시 흐름도 환율 하락에 우호적. 월가에서 바이든 후보의 우세를 대규모 인프라 투자와 부양책 확대에 근거하여 긍정적으로 보기 시작. 글로벌 위험선호 회복에 국내증시가 상승하고 외인 자금이 유입된 점이 환율에 하방 압력을 기중할 것으로 예상. 전 거래일 외국인들은 약 7,500억원 가까이 순매수하며 7월 28일 이후 최대규모를 기록. 금일 또한 완만한 증시 상승세 속 외국인의 순매수 기조가 이어질 가능성이 높음.

다만 한달 새 30원 이상 하락하는 등 급격한 환율 변동에 따른 당국의 미세조정 경계는 환율의 하방을 제한 가능한 요인. 가파른 하락에 하단에서 저가매수 수요가 적극 대응할 수 있는 점에도 유의해야할 것.

## USD Futures &amp; Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD010	1,152.80	-5.20	1,157.80	1,158.90	1,152.20	6.70	305,256	-16,134	737,388	-2,941
USD011	1,152.80	-5.50	1,158.60	1,158.90	1,152.50	6.40	8,361	1,197	22,363	5,140
USD SPOT	1,153.30	-4.90	1,157.00	1,158.80	1,153.30	5.50	6,833	-446	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	67,778	93,000	-25,222	-95,699	-11,660
은행	1,749	7,605	-5,856	-10,040	9,788
투신	4,208	3,713	495	-3,494	-18,944
보험	253	720	-467	-4,359	422
기타법인	14,800	8,346	6,454	16,370	37,395
개인	39,052	29,393	9,659	21,457	22,901
외국인	192,355	177,418	14,937	75,725	-39,902

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,391.96	5.02
국고채3Y	0.907	-0.003
국고채10Y	1.543	0.010

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	24.178	0.097

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	7,604	9,380	11,354
KOSDAQ	30	-788	-3,072
국고채	4,671	15,677	52,902
통안채	899	13,059	33,111

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14525	-0.00163
Call	0.480	0.000	3M	0.22413	0.00363
CD	0.630	0.000	6M	0.24575	-0.00063
통안1년	0.699	-0.003	12M	0.34763	-0.00187

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	28,586.90	161.39	0.57	3.27
S&P	3,477.13	30.30	0.88	3.84
나스닥	11,579.94	158.96	1.39	4.56
FTSE 100	6,016.65	38.62	0.65	1.94
DAX 30	13,051.23	9.02	0.07	2.85
Nikkei 225	23,619.69	-27.38	-0.12	2.56
Shanghai	3,272.08	54.02	1.68	1.52
항셍 H	9,617.85	-6.63	-0.07	2.35
미국채 2년	0.15	0.00	1.39	18.62
미국채 10년	0.77	-0.01	-1.46	10.45
WTI	40.60	-0.59	-1.43	9.58
Gold	1,885.38	-1.20	-0.06	-1.22

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.05	0.00
3M	-0.20	-0.05
6M	-0.60	0.00
12M	-1.90	-0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.100	0.000
2Y	0.055	0.015
3Y	0.065	0.015
4Y	0.090	0.010
5Y	0.170	0.010

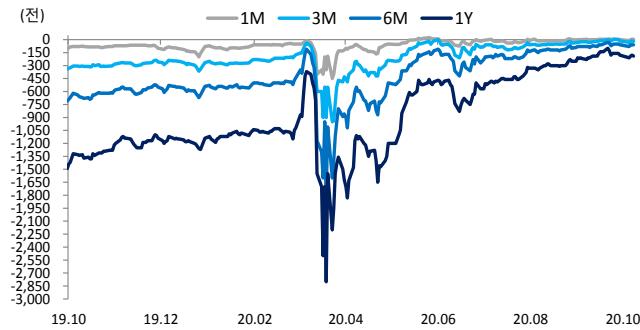
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.057	-0.548	-0.84	USD/KRW	1,153.40	-4.90	-1.39	USD/RUB	76.7800	-0.5707	-1.81
EUR/USD	1.1826	0.0067	0.94	USD/CNY	6.6947	-0.0961	-1.89	USD/BRL	5.5327	-0.0683	-2.70
USD/JPY	105.62	-0.41	0.31	USD/HKD	7.7501	-0.0001	0.00	USD/ZAR	16.4675	-0.1229	-0.37
GBP/USD	1.3036	0.0098	0.78	USD/SGD	1.3548	-0.0034	-0.66	USD/MXN	21.1387	-0.2594	-2.21
USD/CHF	0.9107	-0.0063	-1.08	USD/TWD	29.039	-0.037	-0.39	USD/PLN	3.7789	-0.0387	-1.69
AUD/USD	0.7240	0.0075	1.10	USD/INR	73.13	-0.11	-0.02	USD/TRY	7.8745	-0.0704	1.28
NZD/USD	0.6666	0.0089	0.38	USD/IDR	14,700	-10	-1.11	USD/SEK	8.7821	-0.0814	-1.72
USD/CAD	1.3121	-0.0075	-1.41	USD/THB	31.070	-0.110	-1.68	USD/NOK	9.1372	-0.1244	-1.92

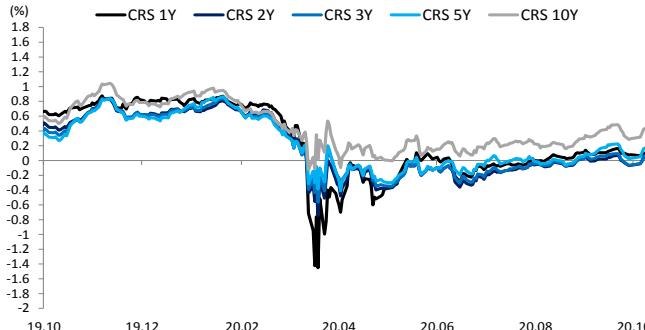
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



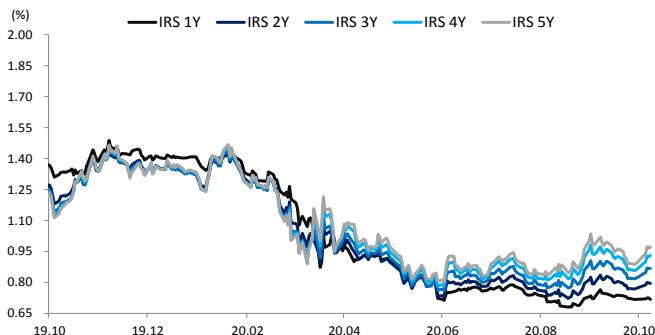
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



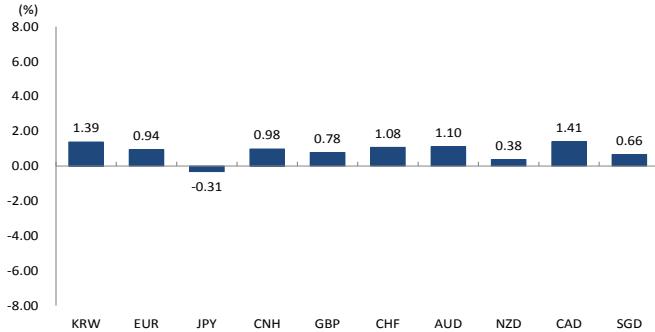
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



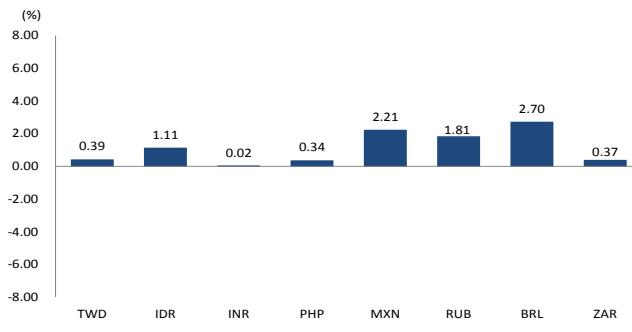
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터